

東京短資デイリーレポート

2024/11/20

<11月19日のマネタリーベース>

6,693,100

<11月20日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーオペ
日銀発表の日銀当座預金残高	5,447,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,451,200
日銀当座預金残高増減前日比	-3,500

<11月20日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		
銀行券要因		-200
財政等要因		-10,000
資金過不足		-10,200
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補完供給	+8,600	-4,700
金融調節合計		+3,800
当座預金増減-②		-6,400

<11月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,444,800
準備預金残高	4,877,300
積み終了先	4,872,800
超過準備	4,866,500
非準備先残高	567,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,912,200
今積み期間所要準備額(平均)	130,400
残り要積立額(積数)	22,200
残り要積立額(平均)	900
準備進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	16.7
進捗率乖離幅	+82.7

<11月21日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		
銀行券要因		-700
財政等要因		+7,300
資金過不足		+6,600
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入		+300
国債補完供給	+4,700	
金融調節合計		+4,800
当座預金増減		+11,400

<11月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残545兆6,200億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<11月21日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,501,200	+56,400
+40,000	5,496,200	+51,400
+35,000	5,491,200	+46,400
+30,000	5,486,200	+41,400
+25,000	5,481,200	+36,400
+20,000	5,476,200	+31,400
+15,000	5,471,200	+26,400
+10,000	5,466,200	+21,400
+5,000	5,461,200	+16,400
±0	5,456,200	+11,400
-5,000	5,451,200	+6,400
-10,000	5,446,200	+1,400
-15,000	5,441,200	-3,600
-20,000	5,436,200	-8,600
-25,000	5,431,200	-13,600
-30,000	5,426,200	-18,600
-35,000	5,421,200	-23,600
-40,000	5,416,200	-28,600
-45,000	5,411,200	-33,600

<11月20日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/11/20-24/11/21	応札 4,790億 落札 4,790億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/11/20-24/11/21	応札 0億 落札 0億

<11月20日 各オペ残高と内訳> (カッコ内は先日付スタート・#印はエンドが13時同時処理)

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初末)	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給
99,227	29,053	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
11/13-11/27 8,006.	11/13(1-3Y) 3,253.	29,719	857,802
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/13(3-5Y) 3,254.	12/ 2-12/ 2 1,712.	12/15-12/13 54,701.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/13(5-10Y) 3,756.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/10~ 1/10 20,011.	11/13(10-25Y) 1,511.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.
1/13~ 1/14 20,008.	11/19(1-3Y) 3,256.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.
1/16~ 1/16 20,009.	11/19(5-10Y) 3,758.	12/ 1-12/ 1 2,464.	※直近約1年分の期落ち分を記載
1/19~ 1/20 1,163.	11/19(10-25Y) 1,502.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	米ドル資金供給オペ
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	2百万ドル
		12/ 4-12/ 4 3,325.	11/14-11/21 2.
			(11/21-11/29 1.)
		※直近約1年分の期落ち分を記載	
		成長基盤強化支援米ドル特別	
		12,401百万ドル	
		12/ 4-12/ 4 3,325.	
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
		9/ 5~ 9/ 5 1,661.	
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売入先(米ドルオペ用担保)	
		2	
		11/20-12/ 2 2.	
		国庫短期証券買入額(月初末)	
		0	
		国債売入先オペ	
		0	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		国債買入額(固定利回)(月初末)	
		0	
		国債補完供給	
		4,790	
		11/20-11/21 4,790.	
		11/20-11/21 0.	
		ETF買入額	
		356,921	
		約定 23/10/ 4 701.	
		ETF買入額(企業支援)	
		14,628	
		約定 21/ 3/31 12.	
		J-REIT買入額	
		6,823	
		約定 22/ 6/14 12.	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		共通担保(全店)金利入札	
		70,035	
		1/24~ 1/24 10,003.	
		2/ 1~ 2/ 1 10,004.	
		2/15~ 2/15 10,004.	
		3/ 1~ 3/ 1 10,010.	
		9/15~ 9/15 10,005.	
		10/10-10/10 10,006.	
		10/25-10/25 10,003.	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		共通担保(全店)固定金利	
		99,227	
		11/13-11/27 8,006.	
		1/ 6~ 1/ 6 20,014.	
		1/ 5~ 1/ 6 10,016.	
		1/10~ 1/10 20,011.	
		1/13~ 1/14 20,008.	
		1/16~ 1/16 20,009.	
		1/19~ 1/20 1,163.	
		11/13(1-3Y) 3,253.	
		11/13(3-5Y) 3,254.	
		11/13(5-10Y) 3,756.	
		11/13(10-25Y) 1,511.	
		11/19(1-3Y) 3,256.	
		11/19(5-10Y) 3,758.	
		11/19(10-25Y) 1,502.	
		12/ 2-12/ 2 1,712.	
		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	
		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	
		12/ 1-12/ 1 2,464.	
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	
		12/ 4-12/ 4 3,325.	
		成長基盤強化支援米ドル特別	
		12,401百万ドル	
		12/ 4-12/ 4 3,325.	
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
		9/ 5~ 9/ 5 1,661.	
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売入先(米ドルオペ用担保)	
		2	
		11/20-12/ 2 2.	
		国庫短期証券買入額(月初末)	
		0	
		国債売入先オペ	
		0	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		国債買入額(固定利回)(月初末)	
		0	
		国債補完供給	
		4,790	
		11/20-11/21 4,790.	
		11/20-11/21 0.	
		ETF買入額	
		356,921	
		約定 23/10/ 4 701.	
		ETF買入額(企業支援)	
		14,628	
		約定 21/ 3/31 12.	
		J-REIT買入額	
		6,823	
		約定 22/ 6/14 12.	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		共通担保(全)固定	
		99,227	
		CP等買入(推定)	
		17,200	
		共通担保(全)金入	
		70,035	
		社債等買入(推定)	
		53,500	
		国債買入先	
		0	
		被災地金融機関支援	
		863	
		気候変動対応支援	
		119,626	
		成長基盤支援	
		25,566	
		手形売出	
		0	
		貸出増加支援	
		783,814	
		国債売入先	
		0	
		供給オペ合計	
		1,099,131	
		国債補完供給	
		4,790	
		貸出(推定)	
		-36	
		国債売入先(米ドル担保)	
		2	
		供給額合計	
		1,099,095	
		吸収額合計	
		4,792	
		差し引き	
		1,094,303	

※成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日が同じ場合まとめて表示しています。
ETF・J-REIT買入は、買入総額と直近の買入を表示しています。共通担保・成長基盤強化支援・貸出増加支援の
各資金供給オペの貸付残高は、期日前返済による減少があるため、貸付額の合計とは必ずしも一致しません。

<11月20日のオープン市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
S/N	+0.200	1M	-----	3M	買気配 +0.150
1W	売気配 +0.200	2M	+0.399000	6M	買気配 +0.300
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.300
1M	売気配 +0.200				

<11月19日のJ-レ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	121,372	+5,008
有担保	40,148	+715
無担保	81,224	+4,293

<11月20日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

	無担保コール				有担保コール				東京レポレート	
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均値	前日比
翌日物	0.220	0.275	0.227	±0				-----	0.231	±0
トムネ			0.275	-----				-----	0.238	±0
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.226	0.390	0.229	-0.067				-----	0.211	+0.002
2週間物			0.270	-----				-----	0.212	±0
3週間物				-----				-----	0.214	+0.001
1ヶ月物			0.295	-0.045				-----	0.274	+0.002
3ヶ月物			0.360	-----				-----	0.352	±0
6ヶ月物				-----				-----	0.411	+0.004
1年物				-----				-----		

本資料は情報提供を目的としてのみ作成されたものであり、お取引の最終決定は御自身の判断でなされますようお願いいたします。
本資料に記載されている内容は、信頼できる情報源に基づき作成されたものですが、弊社はその正確性および確実性を保証するものではありません。
非上場債券(国債、CP等)を当社が相手方となりお買付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。
債券は、金利水準の変化等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。
商号等：東京短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第524号 加入協会：日本証券業協会