

東京短資デイリーレポート

2024/12/5

<12月4日のマナタリーベース>

6,538,600

<12月5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	5,302,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,288,800
日銀当座預金残高増減前日比	+13,300

<12月5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	-2,000
財政等要因	+2,400
資金過不足	+400
金融調節	
国債買入	期落 新規
国債買入	+9,300
国債補完供給	+5,100 -5,400
金融調節合計	+9,000
当座預金増減-②	+9,400

<12月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,298,200
準備預金残高	4,746,600
積み終了先	4,746,500
超過準備	4,746,500
非準備先残高	551,600

<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)	400
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	66.7
進捗率乖離幅	+33.2

<12月6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	-1,200
財政等要因	-7,700
資金過不足	-8,900
金融調節確定分	
CP等買入	期落 新規
社債等買入	-200
国債補完供給	+5,400
金融調節合計	+5,000
当座預金増減	-3,900

<12月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残529兆4,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での出合いが中心か。
--

<12月6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	5,339,300	+41,100
+40,000	5,334,300	+36,100
+35,000	5,329,300	+31,100
+30,000	5,324,300	+26,100
+25,000	5,319,300	+21,100
+20,000	5,314,300	+16,100
+15,000	5,309,300	+11,100
+10,000	5,304,300	+6,100
+5,000	5,299,300	+1,100
±0	5,294,300	-3,900
-5,000	5,289,300	-8,900
-10,000	5,284,300	-13,900
-15,000	5,279,300	-18,900
-20,000	5,274,300	-23,900
-25,000	5,269,300	-28,900
-30,000	5,264,300	-33,900
-35,000	5,259,300	-38,900
-40,000	5,254,300	-43,900
-45,000	5,249,300	-48,900

<12月5日 日銀オペ入札結果>

※スペースの関係上、内容を省略する場合があります。詳細は弊社HPをご参照ください。

(11:50) 国債補完供給	24/12/ 5-24/12/ 6	応札 5,508億	落札 5,508億	全取 -0.050%	平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/12/ 5-24/12/ 6	応札 3億	落札 3億	全取 -0.050%	平均 -0.050%

<12月5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
9,922.6	9,521	成長基盤強化支援資金供給	863
11/27-12/11 8,005.	11/29(3-5Y) 3,253.	貸出増加支援資金供給	857,802
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/29(5-10Y) 3,756.	28,007	2/17~ 2/17 346.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/29(10-25Y) 1,505.	6,793.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.	11/29(物国) 600.	2,644.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.	12/ 5(-1Y) 1,501.	5,024.	8/19~ 8/18 279.
1/16~ 1/16 20,009.	12/ 5(1-3Y) 3,255.	9/ 1~ 9/ 1 2,464.	8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	12/ 5(3-5Y) 3,259.	12/ 1~12/ 1 2,464.	11/18~11/17 57.
	12/ 5(10-25Y) 1,506.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	11/17~11/17 0.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	2/16~ 2/16 0.
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			米ドル資金供給オペ
			3百万ドル
			12/ 5-12/12 3.
			※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
			9,918百万ドル
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.
			6/ 3~ 6/ 3 5,318.
			9/ 5~ 9/ 5 1,661.
			12/ 4-12/ 4 842.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			4
			12/ 4-12/13 4.
			国庫短期証券買入額(月初末)
			0
			国債売現先オペ
			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
			5,511
			12/ 5-12/ 6 5,508.
			12/ 5-12/ 6 3.
			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
			C P買入額(月初末)
			0
			社債買入額(月初末)
			0

<12月5日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,226	CP等買入(推定)	16,600
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	53,100
国債買現先	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	24,018	手形売出	0
貸出増加支援	783,814	国債売現先	0
供給オペ合計	1,097,582	国債補完供給	5,511
貸出(推定)	-36	国債売現先(米ドル担保)	4
供給額合計	1,097,546	吸収額合計	5,515
		差し引き	1,092,031

※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。

<12月5日のオプション市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP現先	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N +0.200	1M +0.445000	3M 買気配 +0.180
1W 売気配 +0.200	2M -----	6M 買気配 +0.350
2W 売気配 +0.200	3M -----	1Y 買気配 +0.350
1M 売気配 +0.200		

<12月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	119,251	+1,488
有担保	39,489	-516
無担保	79,762	+2,004

<12月5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	0.200	0.275	0.232	+0.005			0.180	±0	0.238	+0.001
トムネ				-----				-----	0.240	±0
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.230	-0.013				-----	0.212	±0
2週間物			0.300	+0.010				-----	0.215	+0.002
3週間物				-----				-----	0.228	+0.001
1ヶ月物			0.610	-----				-----	0.256	+0.002
3ヶ月物			0.480	-0.068				-----	0.341	+0.008
6ヶ月物				-----				-----	0.388	+0.002
1年物				-----				-----	0.465	+0.006

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