

東京短資デイリーレポート

2024/12/12

<12月11日のマネタリーベース>

Table with 1 row and 1 column: 6,507,300

<12月12日9時20分日銀オペ後の状況>

Table with 3 columns: 9時20分の日銀オペ, ノーオペ, and values for 日銀発表の日銀当座預金残高, 前日の日銀当座預金残高, 日銀当座預金残高増減前日比.

<12月12日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

Table with 2 columns: 資金需給実績 (銀行券要因, 財政等要因, 資金過不足) and 金融調節 (社債等買入, 国債補完供給, 金融調節合計, 当座預金増減).

<12月12日の日銀当座預金状況>

Table with 2 columns: 当座預金残高 (準備預金残高, 積み終了先, 超過準備, 非準備先残高).

<参考>

Table with 2 columns: 今積み期間所要準備額 (積数), 残り要積立額 (積数), 進捗率 (進捗率, 日数進捗率, 進捗率乖離幅).

<12月13日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

Table with 2 columns: 資金需給予想 (銀行券要因, 財政等要因, 資金過不足) and 金融調節確定分 (社債等買入, 国債補完供給, 貸出増加支援, 金融調節合計).

<12月13日のオペ予想>

Table with 1 column: 朝一の金融調節はノーオペ (当預残531兆6,300億円)で無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227%での合いが中心か.

<12月13日9時20分の日銀当座預金状況>

Table with 3 columns: 9時20分の日銀オペ, 日銀当座預金残高, 前日比増減. Values range from +45,000 to -45,000.

<12月12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。

Table with 4 columns: (11:50) 国債補完供給, (13:50) 国債補完供給, 応札, 落札. Values include 24/12/12-24/12/13, 4,364億, 0億.

<12月12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)

Complex table with multiple columns: 共通担保(全店)固定金利, 国債買入額(月初末), 貸出増加支援資金供給, 被災地金融機関支援資金供給, 国債買現先オペ, C/P買入額(月初末), 社債買入額(月初末), 国債売現先オペ, 国債買入額(固定利回)(月初末).

<12月12日 日銀信用概算(除く買切)>

Table with 4 columns: 共通担保(全)固定, 共通担保(全)金入, 国債買現先, 被災地金融機関支援, 成長基盤支援, 貸出増加支援, 供給オペ合計, 貸出(推定), 供給額合計.

※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12日のオープン市場気配レート(単位:%)>

Table with 4 columns: NCD/CP現先, CPプライマリ, TBアウトライト, S/N. Values include +0.200, +0.469000, +0.180, etc.

<12月11日のJ-REIT市場残高(単位:億円)>

Table with 3 columns: 市場合計, 有担保, 無担保. Values include 118,938, 39,325, 79,613.

<12月12日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

Table with 9 columns: 無担保コール (最低, 最高, 平均, 前日比), 有担保コール (最低, 最高, 平均, 前日比), 東京レポレート (平均値, 前日比). Values include 0.219, 0.275, 0.227, etc.

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