

東京短資デイリーレポート

2024/12/20

<12月19日のマネタリーベース>

6,574,500

<12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	5,352,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,302,300
日銀当座預金残高増減前日比	+49,700

<12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		-2,700
財政等要因		+45,300
資金過不足		+42,600
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-400	
社債等買入	-500	+200
国債補完供給	+4,300	-11,600
金融調節合計		-8,000
当座預金増減-②		+34,600

<12月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,336,900
準備預金残高	4,805,400
積み終了先	4,803,800
超過準備	4,798,800
非準備先残高	531,500

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,063,800
今積み期間所要準備額 (平均)	131,100
残り要積立額 (積数)	17,900
残り要積立額 (平均)	700
準備進捗率(%)	99.5
日数進捗率(%)	22.6
進捗率乖離幅	+76.9

<12月23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		-2,400
財政等要因		-7,600
資金過不足		-10,000
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+11,400
CP等買入	-300	
国債補完供給	+11,600	
金融調節合計		+22,700
当座預金増減		+12,700

<12月23日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残534兆9,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<12月23日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,394,600	+57,700
+40,000	5,389,600	+52,700
+35,000	5,384,600	+47,700
+30,000	5,379,600	+42,700
+25,000	5,374,600	+37,700
+20,000	5,369,600	+32,700
+15,000	5,364,600	+27,700
+10,000	5,359,600	+22,700
+5,000	5,354,600	+17,700
± 0	5,349,600	+12,700
-5,000	5,344,600	+7,700
-10,000	5,339,600	+2,700
-15,000	5,334,600	-2,300
-20,000	5,329,600	-7,300
-25,000	5,324,600	-12,300
-30,000	5,319,600	-17,300
-35,000	5,314,600	-22,300
-40,000	5,309,600	-27,300
-45,000	5,304,600	-32,300

<12月20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。

(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	24/12/23	3,250億	応札 9,235億	落札 3,253億	最低 -0.050%	平均 -0.046%	按分 15.5%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/12/23	3,250億	応札 12,986億	落札 3,253億	最低 -0.051%	平均 -0.050%	按分 92.5%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/12/23	3,750億	応札 9,218億	落札 3,756億	最低 -0.048%	平均 -0.047%	按分 73.9%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/12/23	1,500億	応札 2,529億	落札 1,502億	最低 -0.034%	平均 -0.024%	按分 38.2%
(11:50) 国債補完供給	24/12/20-24/12/23		応札 12,104億	落札 12,104億	全取 +0.050%	平均 +0.050%	
(13:50) 国債補完供給	24/12/20-24/12/23		応札 0億	落札 0億			

<12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)	貸出支援基金の運用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
9,229	29,052	成長基盤強化支援資金供給	863
12/11-12/25	8,008.	28,007	836,939
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.
1/10~ 1/10	20,011.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.
1/13~ 1/14	20,008.	12/ 1~12/ 1	2,464.
1/16~ 1/16	20,009.	3/ 2~ 3/ 2	7,922.
1/19~ 1/20	1,163.	6/ 3~ 6/ 3	3,160.
		12/23(10-25Y)	1,502.
		12/23(10-25Y)	1,502.
		6/ 3~ 6/ 3	5,318.
		3/ 4~ 3/ 4	2,097.
		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)	0
		国債売現先オペ	0
		国債買入額(固定利回)(月初末)	0
		国債補完供給	12,104
		12/20-12/23	12,104.
		12/20-12/23	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.
		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。	
		CP買入額(月初末)	0
		社債買入額(月初末)	250
		12/20	250.
		国債買現先	0
		被災地金融機関支援	863
		成長基盤強化支援	24,018
		貸出増加支援	771,475
		供給オペ合計	1,085,246
		貸出(推定)	-36
		供給額合計	1,085,210
		手形売出	0
		国債売現先	0
		国債補完供給	12,104
		国債売現先(米ドル担保)	0
		吸収額合計	12,104
		差し引き	1,073,106

<12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 +0.330000	3M 買気配 +0.300
1W 売気配 +0.200	2M +0.418000	6M 買気配 +0.300
2W 売気配 +0.200	3M +0.475000	1Y 買気配 +0.300
1M 売気配 +0.200		

<12月19日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	119,610	-867
有担保	38,652	-355
無担保	80,958	-512

<12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	0.200	0.228	0.227	± 0			0.180	± 0	0.234	-0.005
トムネ				-----				-----	0.242	-0.009
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.269	0.400	0.299	+0.011				-----	0.229	-0.003
2週間物				-----				-----	0.228	-0.003
3週間物				-----				-----	0.228	-0.007
1ヶ月物	0.290	0.310	0.303	-0.007				-----	0.233	-0.006
3ヶ月物			0.460	-----				-----	0.331	-0.017
6ヶ月物				-----				-----	0.397	± 0
1年物				-----				-----	0.490	+0.001

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