

東京短資デイトリーレポート

2023/11/2

<11月1日のマナタリーベース>

6,755,400

<11月2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 5,536,200
前日の日銀当座預金残高-① 5,498,600
日銀当座預金残高増減前日比 +37,600

<11月2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 -400
財政等要因 -4,700
資金過不足 -5,100
金融調節
国債買入 期落 新規 +4,000
CP等買入 -200
国債補充供給 +36,900 -44,300
金融調節合計 -3,600
当座預金増減-② -8,700

<11月2日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②) 5,489,900
準備預金残高 4,779,600
積み終了先 4,779,200
超過準備 4,778,700
非準備先残高 710,300

<参考>

今積み期間所要準備額(積数) 4,006,500
今積み期間所要準備額(平均) 129,200
残り要積立額(積数) 3,700
残り要積立額(平均) 400
準備進捗率(%) 99.9
日数進捗率(%) 67.7
進捗率乖離幅 +32.2

<11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 +400
財政等要因 -27,900
資金過不足 -27,500
金融調節確定分
国債補充供給 期落 新規 +44,300
金融調節合計 +44,300
当座預金増減 +16,800

<11月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残550兆6,700億円)で
無担保コール0/Nは-0.020%~-0.010%
での出合いが中心か。

<11月6日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分の日銀当座預金残高 前日比増減
+45,000 5,551,700 +61,800
+40,000 5,546,700 +56,800
+35,000 5,541,700 +51,800
+30,000 5,536,700 +46,800
+25,000 5,531,700 +41,800
+20,000 5,526,700 +36,800
+15,000 5,521,700 +31,800
+10,000 5,516,700 +26,800
+5,000 5,511,700 +21,800
± 0 5,506,700 +16,800
-5,000 5,501,700 +11,800
-10,000 5,496,700 +6,800
-15,000 5,491,700 +1,800
-20,000 5,486,700 -3,200
-25,000 5,481,700 -8,200
-30,000 5,476,700 -13,200
-35,000 5,471,700 -18,200
-40,000 5,466,700 -23,200
-45,000 5,461,700 -28,200

<11月2日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補充供給 23/11/ 2-23/11/ 6 応札 45,431億 落札 45,431億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給 23/11/ 2-23/11/ 6 応札 0億 落札 0億

<11月2日 各オペ残高と内訳>

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
98,282 4,012 45,909 776,646 11/19-11/17 0.
10/25-11/ 8 7,061. 10/30(3-5Y) 4,505. 12/ 4-12/ 4 10,258. 12/16-12/15 20,601. 2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014. 10/30(5-10Y) 6,759. 3/ 4~ 3/ 4 2,178. 3/18~ 3/18 41,458. 5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016. 10/30(10-25Y) 2,003. 6/ 3~ 6/ 3 1,950. 6/19~ 6/19 63,179. 8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011. 10/30(25Y-) 1,001. 9/ 2~ 9/ 2 1,804. 9/16~ 9/13 132,310. 11/18-11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008. 10/30(物国) 602. 12/ 2-12/ 2 1,712. ※直近約1年分の期落ち分を記載
1/16~ 1/16 20,009. 11/ 2(3-5Y) 1,003. 3/ 3~ 3/ 3 6,793. 5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163. 11/ 2(5-10Y) 3,009. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 米ドル資金供給オペ 8/18~ 8/18 0.
9/ 1~ 9/ 1 5,024. 11/ 2-11/ 9 0.
※直近約1年分の期落ち分を記載
成長基盤強化支援ドル特別 16,708百万ドル
12/ 2-12/ 4 3,607.
3/ 3~ 3/ 4 2,153.
6/ 2~ 6/ 3 5,566.
9/ 5~ 9/ 5 5,382.
国債買入先オペ 0 国債売先(米ドルオペ用担保) 0
国債売先オペ 0
国債買入額(固定利回)(月初末) 0
国債補充供給 45,431
11/ 2-11/ 6 45,431.
11/ 2-11/ 6 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
C P買入額(月初末) 0
社債買入額(月初末) 0
社債買入額(月初末) 0
C P買入額(月初末) 0
C P買入額(月初末) 0

※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2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 0.000 1M +0.001000 3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020 2M +0.010000 6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020 3M ----- 1Y 買気配 -0.130
1M 売気配 -0.020

<11月1日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計 193,072 -5,078
有担保 26,410 +1,773
無担保 166,662 -6,851

<11月2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 -0.087 0.001 -0.011 +0.005 ----- -0.155 -0.052
トムネ ----- -0.149 -0.009
スポネ -----
1週間物 -0.040 -0.008 -0.024 +0.002 ----- -0.157 +0.001
2週間物 -0.025 0.001 -0.018 -0.007 ----- -0.164 -0.001
3週間物 ----- -0.168 +0.001
1ヶ月物 -0.013 0.001 -0.005 -0.007 ----- -0.175 ± 0
3ヶ月物 ----- -0.189 +0.002
6ヶ月物 ----- -0.116 +0.002
1年物 ----- -0.083 +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