

東京短資デイリーレポート

2023/11/21

<11月20日のマネタリーベース>

6,697,700

<11月21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	5,479,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,443,600
日銀当座預金残高増減前日比	+35,500

<11月21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		-3,300
資金過不足		-3,700
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入		+1,000
国債補完供給	+37,300	-38,200
金融調節合計		± 0
当座預金増減-②		-3,700

<11月21日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,439,900
準備預金残高	4,737,200
積み終了先	4,732,300
超過準備	4,732,100
非準備先残高	702,700

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,891,200
今積み期間所要準備額 (平均)	129,700
残り要積立額 (積数)	32,000
残り要積立額 (平均)	1,300
準備進捗率(%)	99.1
日数進捗率(%)	20.0
進捗率乖離幅	+79.1

<11月22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		-1,400
財政等要因		-12,000
資金過不足		-13,400
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-6,600	+6,400
CP等買入	-300	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+38,200	
金融調節合計		+38,600
当座預金増減		+25,200

<11月22日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆5,100億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<11月22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	5,510,100	+70,200
+40,000	5,505,100	+65,200
+35,000	5,500,100	+60,200
+30,000	5,495,100	+55,200
+25,000	5,490,100	+50,200
+20,000	5,485,100	+45,200
+15,000	5,480,100	+40,200
+10,000	5,475,100	+35,200
+5,000	5,470,100	+30,200
± 0	5,465,100	+25,200
-5,000	5,460,100	+20,200
-10,000	5,455,100	+15,200
-15,000	5,450,100	+10,200
-20,000	5,445,100	+5,200
-25,000	5,440,100	+200
-30,000	5,435,100	-4,800
-35,000	5,430,100	-9,800
-40,000	5,425,100	-14,800
-45,000	5,420,100	-19,800

<11月21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) 国庫短期証券買入	23/11/22	1,000億	応札 6,157億	落札 1,000億	最低 +0.012%	平均 +0.013%	按分 90.0%
(10:40) ミドル資金供給	23/11/24-23/11/30		応札 2ml	落札 2ml	貸付 5.580%		
(11:50) 国債補完供給	23/11/21-23/11/22		応札 38,615億	落札 38,615億	全取 -0.350%	平均 -0.351%	
(13:00) 共通担保(全)固	23/11/22-23/12/ 6		応札 6,360億	落札 6,360億	貸付 0.000%		
(13:50) 国債補完供給	23/11/21-23/11/22		応札 16億	落札 16億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(14:45) ミドルオペ用担保供給	23/11/22-23/12/ 1	5,000億	応札 2億	落札 2億	全取 -0.100%	平均 -0.100%	

<11月21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
97,831	47,312	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
11/ 8~11/22 6,610.	11/16(1-3Y) 3,752.	45,909	776,646
(11/22~12/ 6 6,360.)	11/16(5-10Y) 5,753.	12/ 4~12/ 4 10,258.	12/16~12/15 20,601.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/16(10-25Y) 2,006.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/16(25Y-) 1,006.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/10~ 1/10 20,011.		9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/13~ 1/14 20,008.		12/ 2~12/ 2 1,712.	
1/16~ 1/16 20,009.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	
1/19~ 1/20 1,163.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			米ドル資金供給オペ
			1百万ドル
			11/16~11/24 1.
			(11/24~11/30 2.)
			※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
			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.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			0
			(11/22~12/ 1 2.)
			国庫短期証券買入額(月初末)
			国債売現先オペ
			1,000
			11/ 8 1,000.
			(11/22 1,000.)
			※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
			CP買入額(月初末)
			3,995
			11/14 3,995.
			社債買入額(月初末)
			1,000
			11/21 1,000.
			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
			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.
			国債補完供給
			38,631
			11/21~11/22 38,615.
			11/21~11/22 16.
			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

※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21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 +0.020000	3M 買気配 -0.250
1W 売気配 -0.020	2M 0.000000	6M 買気配 -0.150
2W 売気配 -0.020	3M +0.030000	1Y 買気配 -0.050
1M 売気配 -0.020		

<11月20日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	191,725	+9,056
有担保	27,247	+3,424
無担保	164,478	+5,632

<11月21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	-0.080	0.001	-0.012	+0.001					-0.094	+0.002
トムネ									-0.107	+0.004
スポネ										
1週間物	-0.015	-0.008	-0.013	+0.020					-0.144	+0.002
2週間物	-0.020	-0.015	-0.019	+0.002					-0.162	-0.001
3週間物									-0.169	+0.001
1ヶ月物			0.011	+0.031					-0.183	± 0
3ヶ月物	0.025	0.150	0.027	+0.002					-0.194	+0.001
6ヶ月物									-0.120	± 0
1年物									-0.080	± 0

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、ETF・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