

東京短資デイリーレポート

2023/11/22

<11月21日のマネタリーベース>

6,694,400

<11月22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	5,465,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,439,900
日銀当座預金残高増減前日比	+25,200

<11月22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		-1,300
財政等要因		-11,200
資金過不足		-12,500
金融調節		
	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	
国債補充供給	+38,200	-38,900
金融調節合計		-300
当座預金増減-②		-12,800

<11月22日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,427,100
準備預金残高	4,728,800
積み終了先	4,726,600
超過準備	4,725,200
非準備先残高	698,300

<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)	25,000
残り要積立額(平均)	1,100
準備進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	26.7
進捗率乖離幅	+72.6

<11月24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		+100
財政等要因		+7,000
資金過不足		+7,100
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+14,100
CP等買入	-400	
社債等買入	-300	
国債補充供給	+38,900	
金融調節合計		+52,300
当座預金増減		+59,400

<11月24日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆6,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<11月24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	5,531,500	+104,400
+40,000	5,526,500	+99,400
+35,000	5,521,500	+94,400
+30,000	5,516,500	+89,400
+25,000	5,511,500	+84,400
+20,000	5,506,500	+79,400
+15,000	5,501,500	+74,400
+10,000	5,496,500	+69,400
+5,000	5,491,500	+64,400
±0	5,486,500	+59,400
-5,000	5,481,500	+54,400
-10,000	5,476,500	+49,400
-15,000	5,471,500	+44,400
-20,000	5,466,500	+39,400
-25,000	5,461,500	+34,400
-30,000	5,456,500	+29,400
-35,000	5,451,500	+24,400
-40,000	5,446,500	+19,400
-45,000	5,441,500	+14,400

<11月22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)	23/11/24	3,750億	応札 9,668億	落札 3,759億	最低 +0.008%	平均 +0.010%	按分 56.3%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/11/24	4,500億	応札 13,481億	落札 4,501億	最低 +0.014%	平均 +0.019%	按分 0.5%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/11/24	5,250億	応札 9,767億	落札 5,257億	最低 +0.016%	平均 +0.018%	按分 27.2%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/11/24	750億	応札 1,802億	落札 753億	最低 +0.052%	平均 +0.054%	按分 17.0%
(11:50) 国債補充供給	23/11/22-23/11/24		応札 39,301億	落札 39,301億	全取 -0.350%	平均 -0.351%	
(13:50) 国債補充供給	23/11/22-23/11/24		応札 1億	落札 1億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	

<11月22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	97,581	国債買入額(月初末)	47,312	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給	1,001
11/22-12/6	6,360	11/16(1-3Y)	3,752	45,909	776,646	2/18~ 2/16	0	
1/6~ 1/6	20,014	11/16(5-10Y)	5,753	12/4~12/4	10,258	5/17~ 5/17	0	
1/5~ 1/6	10,016	11/16(10-25Y)	2,006	3/4~ 3/4	2,178	8/19~ 8/19	381	
1/10~ 1/10	20,011	11/16(25Y-)	1,006	6/3~ 6/3	1,950	11/18~11/18	93	
1/13~ 1/14	20,008	(11/24(1-3Y)	3,759	9/2~ 9/2	1,804	2/17~ 2/17	346	
1/16~ 1/16	20,009	(11/24(3-5Y)	4,501	12/2~12/2	1,712	5/12~ 5/12	181	
1/19~ 1/20	1,163	(11/24(5-10Y)	5,257	3/3~ 3/3	6,793	8/18~ 8/18	0	
		(11/24(25Y-)	753	6/2~ 6/2	2,644	11/17~11/17	0	
				9/1~ 9/1	5,024	11/16-11/24	1	
						(11/24-11/30	2)	
						1百万ドル		
						11/16-11/24	1	
						(11/24-11/30	2)	
						米ドル資金供給オペ		
						11/16-11/24	1	
						(11/24-11/30	2)	
						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)		
						2		
						11/22-12/1	2	
						国庫短期証券買入額(月初末)		
						国債売現先オペ		
						2,000		
						11/8	1,000	
						11/22	1,000	
						CP買入額(月初末)		
						3,995		
						11/14	3,995	
						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		
						国債買入額(固定利回)(月初末)		
						0		
						国債補充供給		
						39,302		
						11/22-11/24	39,301	
						11/22-11/24	1	
						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22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	-----	3M	買気配 -0.250
1W	売気配 -0.020	2M	+0.050000	6M	買気配 -0.150
2W	売気配 -0.020	3M	+0.080000	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

<11月21日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	184,999	-6,726
有担保	25,563	-1,684
無担保	159,436	-5,042

<11月22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	-0.085	0.001	-0.012	±0				-----	-0.092	+0.002
トムネ				-----				-----	-0.106	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.025	-0.019	-0.021	-0.008				-----	-0.137	+0.007
2週間物	-0.023	-0.009	-0.020	-0.001				-----	-0.157	+0.005
3週間物				-----				-----	-0.164	+0.005
1ヶ月物			0.080	+0.069				-----	-0.180	+0.003
3ヶ月物			0.025	-0.002				-----	-0.192	+0.002
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、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