

# 東京短資デイリーレポート

2023/12/6

## <12月5日のマナタリーベース>

6,588,000
-----------

## <12月6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	5,335,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,328,000
日銀当座預金残高増減前日比	+7,800

## <12月6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	-1,200	
財政等要因	-32,000	
資金過不足	-33,200	
金融調節		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-6,400	+6,300
CP等買入	-100	
社債等買入	-300	
国債補完供給	+40,900	-37,700
金融調節合計		+3,700
当座預金増減-②		-29,500

## <12月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,298,500
準備預金残高	4,613,500
積み終了先	4,613,000
超過準備	4,613,000
非準備先残高	685,000

## <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)	3,000
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	70.0
進捗率乖離幅	+29.9

## <12月7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	-2,000	
財政等要因	+1,400	
資金過不足	-600	
金融調節確定分		
	期落	新規
社債等買入	-100	
国債補完供給	+37,700	
金融調節合計		+37,600
当座預金増減		+37,000

## <12月7日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残533兆5,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.010% での出合いが中心か。
--

## <12月7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	5,380,500	+82,000
+40,000	5,375,500	+77,000
+35,000	5,370,500	+72,000
+30,000	5,365,500	+67,000
+25,000	5,360,500	+62,000
+20,000	5,355,500	+57,000
+15,000	5,350,500	+52,000
+10,000	5,345,500	+47,000
+5,000	5,340,500	+42,000
±0	5,335,500	+37,000
-5,000	5,330,500	+32,000
-10,000	5,325,500	+27,000
-15,000	5,320,500	+22,000
-20,000	5,315,500	+17,000
-25,000	5,310,500	+12,000
-30,000	5,305,500	+7,000
-35,000	5,300,500	+2,000
-40,000	5,295,500	-3,000
-45,000	5,290,500	-8,000

## <12月6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。

(11:50) 国債補完供給	23/12/ 6-23/12/ 7	応札 38,015億 落札 38,015億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/12/ 6-23/12/ 7	応札 0億 落札 0億

## <12月6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	97,515	国債買入額(月初末)	10,515	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
12/ 6-12/19	6,294.	11/30(3-5Y)	4,504.	3 5,651	7 76,646	2/18~ 2/16	0.	
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	11/30(5-10Y)	5,255.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	5/17~ 5/17	0.	
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	11/30(10-25Y)	2,001.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	8/19~ 8/19	381.	
1/10~ 1/10	20,011.	11/30(物国)	600.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	6/19~ 6/19	63,179.	
1/13~ 1/14	20,008.	12/ 5(1-3Y)	3,751.	12/ 2-12/ 2	1,712.	9/16~ 9/13	132,310.	
1/16~ 1/16	20,009.	12/ 5(3-5Y)	4,506.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	5/12~ 5/12	181.	
1/19~ 1/20	1,163.	12/ 5(10-25Y)	1,505.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.	8/18~ 8/18	0.	
		12/ 5(25Y-)	753.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.	11/17-11/17	0.	
				12/ 1-12/ 1	2,464.	米ドル資金供給オペ	0	
						0百万ドル		
						11/30-12/ 7	0.	
						(12/ 7-12/14	2.)	
						成長基盤強化支援米ドル特別		
						1 6,426百万ドル		
						3/ 3~ 3/ 4	2,153.	
						6/ 2~ 6/ 3	5,566.	
						9/ 5~ 9/ 5	5,382.	
						12/ 4-12/ 4	3,325.	
						国債買現先オペ	0	
						国債売現先(米ドルオペ用担保)	0	
						国庫短期証券買入額(月初末)		
						国債売現先オペ	1,001	
						12/ 6	1,001.	
						CP買入額(月初末)	0	
						社債買入額(月初末)	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。

## <12月6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 -0.140
1W	売気配 -0.020	2M	0.000000	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

## <12月5日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	195,047	-2,415
有担保	28,189	-1,935
無担保	166,858	-480

## <12月6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	-0.010	+0.001				-----	-0.086	-0.009
トムネ				-----				-----	-0.090	-0.004
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.030	0.008	-0.023	-----				-----	-0.113	+0.002
2週間物			0.000	+0.017				-----	-0.131	±0
3週間物				-----				-----	-0.138	+0.004
1ヶ月物				-----				-----	-0.180	-0.003
3ヶ月物			0.026	-----				-----	-0.166	+0.007
6ヶ月物				-----				-----	-0.115	+0.004
1年物				-----				-----	-0.077	+0.002

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