

東京短資デイリーレポート

2024/11/8

<11月7日のマネタリーベース>

6,729,400

<11月8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	5,471,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,486,500
日銀当座預金残高増減前日比	-14,900

<11月8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	+300
財政等要因	-23,100
資金過不足	-22,800
金融調節	
CP等買入	-600
国債補完供給	+7,900
金融調節合計	-500
当座預金増減-②	-23,300

<11月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,463,200
準備預金残高	4,901,900
積み終了先	4,901,800
超過準備	4,901,800
非準備先残高	561,300

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,035,500
今積み期間所要準備額(平均)	130,200
残り要積立額(積数)	200
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	83.9
進捗率乖離幅	+16.0

<11月11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	+500
財政等要因	+1,600
資金過不足	+2,100
金融調節確定分	
CP等買入	-100
国債補完供給	+7,800
金融調節合計	+7,700
当座預金増減	+9,800

<11月11日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆3,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<11月11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	5,518,000	+54,800
+40,000	5,513,000	+49,800
+35,000	5,508,000	+44,800
+30,000	5,503,000	+39,800
+25,000	5,498,000	+34,800
+20,000	5,493,000	+29,800
+15,000	5,488,000	+24,800
+10,000	5,483,000	+19,800
+5,000	5,478,000	+14,800
± 0	5,473,000	+9,800
-5,000	5,468,000	+4,800
-10,000	5,463,000	-200
-15,000	5,458,000	-5,200
-20,000	5,453,000	-10,200
-25,000	5,448,000	-15,200
-30,000	5,443,000	-20,200
-35,000	5,438,000	-25,200
-40,000	5,433,000	-30,200
-45,000	5,428,000	-35,200

<11月8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	24/11/ 8-24/11/11	応札 7,930億 落札 7,930億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/11/ 8-24/11/11	応札 14億 落札 14億 全取 -0.050% 平均 -0.050%

<11月8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)	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
9,9228	8,763			899
10/30~11/13 8,007.	11/ 7(-1Y) 1,502.	29,719	857,802	11/18~11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/ 7(1-3Y) 3,255.	12/ 2-12/ 2 1,712.	12/15-12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/ 7(3-5Y) 3,255.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.	11/ 7(25Y-) 751.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.	8/19~ 8/18 279.
1/16~ 1/16 20,009.		12/ 1~12/ 1 2,464.		8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.		3/ 2~ 3/ 2 7,922.		11/17~11/17 0.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.		2/16~ 2/16 0.
		12/ 4~12/ 4 3,325.		
			※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/ 7~11/14 1.	
			※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	
			12,401百万ドル	
			12/ 4~12/ 4 3,325.	
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
			6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
			9/ 5~ 9/ 5 1,661.	
			国債買入先オペ	
			0	
			国債売入先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債短期証券買入額(月初末)	
			0	
			国債売入先オペ	
			0	
			※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)	
			0	
			社債買入額(月初末)	
			0	

<11月8日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,228	CP等買入(推定)	18,000
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	53,500
国債買入先	0		
被災地金融機関支援	899		
成長基盤強化支援	119,626	手形売切	0
貸出増加支援	783,814	国債売入先	0
供給オペ合計	1,099,168	国債補完供給	7,944
貸出(推定)	0	国債売入先	0
供給額合計	1,099,168	吸収額合計	7,944
		差し引き	1,091,224

※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8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 +0.268000	3M 買気配 +0.080
1W 売気配 +0.200	2M -----	6M 買気配 +0.230
2W 売気配 +0.200	3M -----	1Y 買気配 +0.350
1M 売気配 +0.200		

<11月7日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	119,090	-729
有担保	37,162	+274
無担保	81,928	-1,003

<11月8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	0.221	0.228	0.227	± 0				-----	0.164	-0.062
トムネ				-----				-----	0.235	+0.004
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.228	-----				-----	0.204	± 0
2週間物			0.290	+0.012				-----	0.204	± 0
3週間物				-----				-----	0.204	± 0
1ヶ月物			0.370	+0.080				-----	0.208	+0.001
3ヶ月物			0.350	-----				-----	0.246	+0.003
6ヶ月物				-----				-----	0.309	+0.001
1年物				-----				-----	0.360	+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