

東京短資デイリーレポート

2023/11/10

<11月9日のマネタリーベース>

6,741,200

<11月10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	5,510,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,485,900
日銀当座預金残高増減前日比	+24,200

<11月10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	+900
財政等要因	-14,300
資金過不足	-13,400
金融調節	
CP等買入	-200
国債補完供給	+37,800
金融調節合計	-3,000
当座預金増減-②	-16,400

<11月10日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,469,500
準備預金残高	4,760,400
積み終了先	4,760,300
超過準備	4,759,900
非準備先残高	709,100

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,009,200
今積み期間所要準備額(平均)	129,300
残り要積立額(積数)	100
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	90.3
進捗率乖離幅	+9.6

<11月13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	-5,900
資金過不足	-5,400
金融調節確定分	
国債買入	+12,100
CP等買入	-100
国債補完供給	+40,600
金融調節合計	+52,600
当座預金増減	+47,200

<11月13日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆6,700億円)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13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	5,561,700	+92,200
+40,000	5,556,700	+87,200
+35,000	5,551,700	+82,200
+30,000	5,546,700	+77,200
+25,000	5,541,700	+72,200
+20,000	5,536,700	+67,200
+15,000	5,531,700	+62,200
+10,000	5,526,700	+57,200
+5,000	5,521,700	+52,200
±0	5,516,700	+47,200
-5,000	5,511,700	+42,200
-10,000	5,506,700	+37,200
-15,000	5,501,700	+32,200
-20,000	5,496,700	+27,200
-25,000	5,491,700	+22,200
-30,000	5,486,700	+17,200
-35,000	5,481,700	+12,200
-40,000	5,476,700	+7,200
-45,000	5,471,700	+2,200

<11月10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)	23/11/13	1,500億	応札 2,663億	落札 1,503億	最低 -0.044%	平均 -0.011%	按分 9.1%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	23/11/13	4,250億	応札 6,650億	落札 4,251億	最低 -0.001%	平均 +0.004%	按分 56.7%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/11/13	4,500億	応札 9,725億	落札 4,504億	最低 +0.016%	平均 +0.018%	按分 35.4%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/11/13	2,000億	応札 5,131億	落札 2,008億	最低 +0.021%	平均 +0.024%	按分 23.9%
(11:50) 国債補完供給	23/11/10-23/11/13		応札 41,452億	落札 41,452億	全取 -0.350%	平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/11/10-23/11/13		応札 0億	落札 0億			

<11月10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
9,783.1	22,529	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
		成長基盤強化支援資金供給	1,001
11/ 8~11/22 6,610.	11/ 7(1-3Y) 4,253.	45,909	776,646
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/ 7(3-5Y) 4,503.	12/ 4~12/ 4 10,258.	12/16~12/15 20,601.
1/ 5~ 1/ 6 20,016.	11/ 7(5-10Y) 6,751.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/10~ 1/10 20,011.	11/ 7(10-25Y) 2,006.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/13~ 1/14 20,008.	11/ 7(25Y-) 1,004.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/16~ 1/16 20,009.	(11/13(-1Y) 1,503.)	12/ 2~12/ 2 1,712.	
1/19~ 1/20 1,163.	(11/13(1-3Y) 4,251.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	
	(11/13(3-5Y) 4,504.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	
	(11/13(10-25Y) 2,008.)	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/ 9~11/16 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
			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
			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.
			※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
			国債補完供給
			41,452
			11/10~11/13 41,452.
			11/10~11/13 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
			(11/14 3,995.)
			社債買入額(月初末)
			0
			社債買入額(推定)
			23,500
			CP等買入(推定)
			64,200
			国債買現先
			0
			被災地金融機関支援
			1,001
			気候変動対応支援
			62,648
			成長基盤強化支援
			39,647
			貸出増加支援
			702,255
			手形売出
			0
			新型コロナ企業金融支援
			0
			国債売現先
			0
			供給オペ合計
			973,417
			国債補完供給
			41,452
			貸出(推定)
			0
			国債売現(米ドル担保)
			0
			供給額合計
			973,417
			吸収額合計
			41,452
			差し引き
			931,965

※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10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 +0.045000	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.050
1M 売気配 -0.020		

<11月9日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	197,823	-396
有担保	26,187	+491
無担保	171,636	-887

<11月10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	-0.070	0.001	-0.014	-0.003					-0.137	-0.004
トムネ									-0.125	+0.012
スポネ										
1週間物	-0.040	-0.024	-0.029	-0.009					-0.149	+0.003
2週間物			-0.013						-0.158	+0.001
3週間物			0.005						-0.167	+0.004
1ヶ月物									-0.174	+0.004
3ヶ月物									-0.193	-0.001
6ヶ月物									-0.117	-0.003
1年物									-0.081	±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