

# 東京短資デイリーレポート

2023/11/17

## <11月16日のマネタリーベース>

6,708,800
-----------

## <11月17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	5,488,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,454,900
日銀当座預金残高増減前日比	+33,300

## <11月17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		-100
財政等要因		-4,700
資金過不足		-4,800
金融調節		
CP等買入	期落	新規
		-200
国債補完供給	+38,300	-36,800
金融調節合計		+1,300
当座預金増減-②		-3,500

## <11月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,451,400
準備預金残高	4,744,200
積み終了先	4,733,600
超過準備	4,592,100
非準備先残高	707,200

## <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)	44,700
残り要積立額(平均)	1,700
準備進捗率(%)	98.8
日数進捗率(%)	13.3
進捗率乖離幅	+85.5

## <11月20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		-5,300
資金過不足		-5,400
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
		-300
社債等買入		-500
国債補完供給	+36,800	
金融調節合計		+36,000
当座預金増減		+30,600

## <11月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆2,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.035%~-0.015% での合いが中心か。
---

## <11月20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	5,527,000	+75,600
+40,000	5,522,000	+70,600
+35,000	5,517,000	+65,600
+30,000	5,512,000	+60,600
+25,000	5,507,000	+55,600
+20,000	5,502,000	+50,600
+15,000	5,497,000	+45,600
+10,000	5,492,000	+40,600
+5,000	5,487,000	+35,600
±0	5,482,000	+30,600
-5,000	5,477,000	+25,600
-10,000	5,472,000	+20,600
-15,000	5,467,000	+15,600
-20,000	5,462,000	+10,600
-25,000	5,457,000	+5,600
-30,000	5,452,000	+600
-35,000	5,447,000	-4,400
-40,000	5,442,000	-9,400
-45,000	5,437,000	-14,400

## <11月17日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	23/11/17-23/11/20	応札 37,400億 落札 37,400億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/11/17-23/11/20	応札 0億 落札 0億

## <11月17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(月初来)	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.	11/13(-1Y) 1,503.	45,909	776,646
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/13(1-3Y) 4,251.	12/ 4~12/ 4 10,258.	12/16~12/15 20,601.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/13(3-5Y) 4,504.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/10~ 1/10 20,011.	11/13(10-25Y) 2,008.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/13~ 1/14 20,008.	11/16(1-3Y) 3,752.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/16~ 1/16 20,009.	11/16(5-10Y) 5,753.	12/ 2~12/ 2 1,712.	※直近約1年分の期落ち分を記載
1/19~ 1/20 1,163.	11/16(10-25Y) 2,006.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	米ドル資金供給オペ
	11/16(25Y-) 1,006.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	11/17~11/17 0.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	100万ドル
			11/16~11/24 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(月初来)
		国債売現先オペ	1,000
		0	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)(月初来)	
		0	
		国債補完供給	
		37,400	
		11/17~11/20 37,400.	
		11/17~11/20 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	
		CP買入額(月初来)	
		3,995	
		11/14 3,995.	
		社債買入額(月初来)	
		0	
		(11/21 1,000.)	
		<11月17日 日銀信用概算(除く買切)>	
		共通担保(全)固定 97,831	CP等買入(推定) 26,800
		共通担保(全)金入 70,035	社債等買入(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	
		成長基盤支援 39,647	手形売切 0
		貸出増加支援 702,255	国債売現先 0
		供給オペ合計 973,417	国債補完供給 37,400
		貸出(推定) 0	国債売現先(米ドル担保) 0
		供給額合計 973,417	吸収額合計 37,400
		差し引き 936,017	

※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17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 -----	6M 買気配 -0.150
2W 売気配 -0.020	3M +0.005000	1Y 買気配 -0.050
1M 売気配 -0.020		

## <11月16日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	181,002	-7,386
有担保	27,468	+433
無担保	153,534	-7,819

## <11月17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	-0.082	0.001	-0.015	+0.012					-0.110	-0.003
トムネ				-----					-0.118	+0.012
スポネ				-----						
1週間物	-0.040	-0.015	-0.027	-0.005					-0.156	+0.003
2週間物	-0.025	-0.001	-0.017	+0.006					-0.169	+0.001
3週間物				-----					-0.175	+0.004
1ヶ月物	-0.020	0.090	-0.009	+0.015					-0.183	+0.005
3ヶ月物				-----					-0.194	+0.003
6ヶ月物				-----					-0.119	±0
1年物				-----					-0.079	+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