

# 東京短資デイリーレポート

2023/11/20

## <11月17日のマネタリーベース>

6,705,400
-----------

## <11月20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	5,482,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,451,400
日銀当座預金残高増減前日比	+30,600

## <11月20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	-200
財政等要因	-6,300
資金過不足	-6,500
金融調節	
CP等買入	-300
社債等買入	-500
国債補完供給	+36,800
金融調節合計	-1,300
当座預金増減-②	-7,800

## <11月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,443,600
準備預金残高	4,746,900
積み終了先	4,741,800
超過準備	4,739,300
非準備先残高	696,700

## <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)	37,100
残り要積立額(平均)	1,500
準備進捗率(%)	99.0
日数進捗率(%)	16.7
進捗率乖離幅	+82.3

## <11月21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	-300
財政等要因	-2,400
資金過不足	-2,700
金融調節確定分	
CP等買入	-100
社債等買入	+1,000
国債補完供給	+37,300
金融調節合計	+38,200
当座預金増減	+35,500

## <11月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆9,100億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.010% での合いが中心か。
---

## <11月21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	5,524,100	+80,500
+40,000	5,519,100	+75,500
+35,000	5,514,100	+70,500
+30,000	5,509,100	+65,500
+25,000	5,504,100	+60,500
+20,000	5,499,100	+55,500
+15,000	5,494,100	+50,500
+10,000	5,489,100	+45,500
+5,000	5,484,100	+40,500
±0	5,479,100	+35,500
-5,000	5,474,100	+30,500
-10,000	5,469,100	+25,500
-15,000	5,464,100	+20,500
-20,000	5,459,100	+15,500
-25,000	5,454,100	+10,500
-30,000	5,449,100	+5,500
-35,000	5,444,100	+500
-40,000	5,439,100	-4,500
-45,000	5,434,100	-9,500

## <11月20日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	23/11/20-23/11/21	応札 37,716億 落札 37,716億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/11/20-23/11/21	応札 150億 落札 150億 全取 -0.350% 平均 -0.350%

## <11月20日 各オペ残高と内訳>

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	1,001			
11/ 8~11/22 6,610.	11/13(-1Y) 1,503.	45,909	776,646	2/18~ 2/16 0.			
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/13(1-3Y) 4,251.	12/ 4~12/ 4 10,258.	12/16~12/15 20,601.	5/17~ 5/17 0.			
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/13(3-5Y) 4,504.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	8/19~ 8/19 381.			
1/10~ 1/10 20,011.	11/13(10-25Y) 2,008.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.			
1/13~ 1/14 20,008.	11/16(1-3Y) 3,752.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.			
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	5/12~ 5/12 181.			
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	8/18~ 8/18 0.			
	11/16(25Y-) 1,006.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	11/17~11/17 0.				
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	11/16~11/24 1.				
		※直近約1年分の期落ち分を記載	16,708百万ドル				
		成長基盤強化支援米ドル特別	12/ 2~12/ 4 3,607.				
		16,708百万ドル	3/ 3~ 3/ 4 2,153.				
		12/ 2~12/ 4 3,607.	6/ 2~ 6/ 3 5,566.				
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.	9/ 5~ 9/ 5 5,382.				
		6/ 2~ 6/ 3 5,566.	9/ 5~ 9/ 5 5,382.				
		9/ 5~ 9/ 5 5,382.	国債買入先オペ				
			0				
			国債売入先(米ドルオペ用担保)				
			0				
			国庫短期証券買入額(月初来)				
			国債売入先オペ				
			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				
			37,866				
			11/20~11/21 150.				
			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20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) 26,500			
			共通担保(全)金入 70,035	社債等買入(推定) 63,700			
			国債買入先 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	国債売入先 0			
			供給オペ合計 973,417	国債補完供給 37,866			
			貸出(推定) 0	国債売入先 0			
			供給額合計 973,417	吸収額合計 37,866			
			差し引き 935,551				

※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20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	+0.024000	3M	買気配 -0.250
1W	売気配 -0.020	2M	+0.010000	6M	買気配 -0.150
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

## <11月17日のJOL市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	182,669	+1,667
有担保	23,823	-3,645
無担保	158,846	+5,312

## <11月20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	-0.013	+0.002					-0.096	+0.014
トムネ				-----					-0.111	+0.007
スポネ				-----						
1週間物	-0.040	-0.008	-0.033	-0.006					-0.146	+0.010
2週間物	-0.030	0.001	-0.021	-0.004					-0.161	+0.008
3週間物			0.005	-----					-0.170	+0.005
1ヶ月物			-0.020	-0.011					-0.183	±0
3ヶ月物			0.025	-----					-0.195	-0.001
6ヶ月物				-----					-0.120	-0.001
1年物				-----					-0.080	-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