

東京短資デイリーレポート

2023/12/1

<11月30日のマネタリーベース>

6,698,500

<12月1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	5,431,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,440,600
日銀当座預金残高増減前日比	-9,000

<12月1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	-600
財政等要因	-44,700
資金過不足	-45,300
金融調節	
社債等買入	-200
国債補完供給	+39,900
金融調節合計	-1,700
当座預金増減-②	-47,000

<12月1日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,393,600
準備預金残高	4,692,700
積み終了先	4,691,700
超過準備	4,691,400
非準備先残高	700,900

<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)	5,100
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	60.0
進捗率乖離幅	+39.8

<12月4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	-600
財政等要因	-66,500
資金過不足	-67,100
金融調節確定分	
CP等買入	-200
国債補完供給	+41,400
成長基盤強化支援	-9,100
金融調節合計	+32,100
当座預金増減	-35,000

<12月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残535兆8,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.010% での合いが中心か。

<12月4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	5,403,600	+10,000
+40,000	5,398,600	+5,000
+35,000	5,393,600	±0
+30,000	5,388,600	-5,000
+25,000	5,383,600	-10,000
+20,000	5,378,600	-15,000
+15,000	5,373,600	-20,000
+10,000	5,368,600	-25,000
+5,000	5,363,600	-30,000
±0	5,358,600	-35,000
-5,000	5,353,600	-40,000
-10,000	5,348,600	-45,000
-15,000	5,343,600	-50,000
-20,000	5,338,600	-55,000
-25,000	5,333,600	-60,000
-30,000	5,328,600	-65,000
-35,000	5,323,600	-70,000
-40,000	5,318,600	-75,000
-45,000	5,313,600	-80,000

<12月1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/ 1-23/12/ 4	応札 41,686億 落札 41,686億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/12/ 1-23/12/ 4	応札 68億 落札 68億 全取 -0.350% 平均 -0.350%

<12月1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)	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
97,581	0	16,708百万ドル	1,001	1,001
11/22-12/ 6	11/24(1-3Y) 3,759.	12/ 4-12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	11/24(3-5Y) 4,501.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	11/24(5-10Y) 5,257.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.	11/24(25Y-) 753.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.	11/30(3-5Y) 4,504.	12/ 2-12/ 2 1,712.	※直近約1年分の期落ち分を記載	2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.	11/30(5-10Y) 5,255.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	米ドル資金供給オペ	5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	11/30(10-25Y) 2,001.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	0百万ドル	8/18~ 8/18 0.
	11/30(物国) 600.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	11/30-12/ 7 0.	11/17-11/17 0.
		※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.		
		(12/ 4-12/ 4 3,325.)		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		CP買入額(月初来)		
		0		
		社債買入額(月初来)		
		0		
		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		
		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		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初来)		
		0		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債売現先オペ</		