

# 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	776,646	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.		2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.	11/30(5-10Y) 5,255.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	11/30(10-25Y) 2,001.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
	11/30(物国) 600.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
共通担保(全店)金利入札		国債買入額(固定利回)(月初来)		国債買入額(固定利回)(月初来)
70,035		0		0
1/24~ 1/24 10,003.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
2/ 1~ 2/ 1 10,004.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
2/15~ 2/15 10,004.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
3/ 1~ 3/ 1 10,010.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
9/15~ 9/15 10,005.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
10/10~10/10 10,006.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
10/25~10/25 10,003.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
国債補完供給		C P買入額(月初来)		0
41,754		0		0
12/ 1-12/ 4 41,686.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
12/ 1-12/ 4 68.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
ETF買入額		社債買入額(月初来)		0
356,921		0		0
約定 23/10/ 4 701.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
ETF買入額(企業支援)	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
14,628	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
約定 21/ 3/31 12.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
J-REIT買入額	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
6,823	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
約定 22/ 6/14 12.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
ETF買入額		社債買入額(月初来)		0
356,921		0		0
約定 23/10/ 4 701.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
ETF買入額(企業支援)	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
14,628	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
約定 21/ 3/31 12.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
J-REIT買入額	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
6,823	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
約定 22/ 6/14 12.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
ETF買入額		社債買入額(月初来)		0
356,921		0		0
約定 23/10/ 4 701.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
ETF買入額(企業支援)	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
14,628	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
約定 21/ 3/31 12.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
J-REIT買入額	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
6,823	国債買入額(固定利回)(月初来)			0
約定 22/ 6/14 12.	国債買入額(固定利回)(月初来)			0

※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。

## <12月1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 -0.150
1W 売気配 -0.020	2M +0.035000	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30日のJOL市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	191,406	-12,465
有担保	27,331	+221
無担保	164,075	-12,686

## <12月1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	-0.015	+0.007				-----	-0.094	-0.003
トムネ				-----				-----	-0.094	+0.007
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.040	-0.035	-0.036	-0.019				-----	-0.124	+0.003
2週間物	-0.035	-0.025	-0.032	-0.002				-----	-0.136	±0
3週間物				-----				-----	-0.144	+0.008
1ヶ月物				-----				-----	-0.183	-0.005
3ヶ月物				-----				-----	-0.183	+0.006
6ヶ月物				-----				-----	-0.114	±0
1年物				-----				-----	-0.076	±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。  
非市場債券(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