

# 東京短資デイリーレポート

2023/12/20

## <12月19日のマネタリーベース>

6,679,100
-----------

## <12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	5,490,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,402,700
日銀当座預金残高増減前日比	+88,000

## <12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	-2,400	
財政等要因	+47,200	
資金過不足	+44,800	
金融調節		
CP等買入	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入	-2,100	
国債補完供給	+44,400	-42,900
金融調節合計		-800
当座預金増減-②		+44,000

## <12月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,446,700
準備預金残高	4,747,600
積み終了先	4,740,000
超過準備	4,737,300
非準備先残高	699,100

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,969,100
今積み期間所要準備額 (平均)	128,000
残り要積立額 (積数)	34,400
残り要積立額 (平均)	1,300
準備進捗率(%)	99.1
日数進捗率(%)	16.1
進捗率乖離幅	+83.0

## <12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	-3,000	
財政等要因	-400	
資金過不足	-3,400	
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
CP等買入	-500	
国債補完供給	+42,900	
金融調節合計		+42,400
当座預金増減		+39,000

## <12月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆5,700億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。
---

## <12月21日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,530,700	+84,000
+40,000	5,525,700	+79,000
+35,000	5,520,700	+74,000
+30,000	5,515,700	+69,000
+25,000	5,510,700	+64,000
+20,000	5,505,700	+59,000
+15,000	5,500,700	+54,000
+10,000	5,495,700	+49,000
+5,000	5,490,700	+44,000
± 0	5,485,700	+39,000
-5,000	5,480,700	+34,000
-10,000	5,475,700	+29,000
-15,000	5,470,700	+24,000
-20,000	5,465,700	+19,000
-25,000	5,460,700	+14,000
-30,000	5,455,700	+9,000
-35,000	5,450,700	+4,000
-40,000	5,445,700	-1,000
-45,000	5,440,700	-6,000

## <12月20日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	23/12/20-23/12/21	応札 42,098億 落札 42,098億 全取 -0.450% 平均 -0.450%
(13:50) 国債補完供給	23/12/20-23/12/21	応札 1,193億 落札 1,193億 全取 -0.450% 平均 -0.450%

## <12月20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
103,843	51,793	成長基盤強化支援資金供給	1,001
12/19~ 1/10 12,622.	12/14(-1Y) 1,500.	貸出増加支援資金供給	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	12/14(1-3Y) 3,759.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	12/14(5-10Y) 5,255.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/10~ 1/10 20,011.	12/14(25Y-) 751.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/13~ 1/14 20,008.	12/19(1-3Y) 3,752.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/16~ 1/16 20,009.	12/19(3-5Y) 4,501.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	12/15~12/13 54,701.
1/19~ 1/20 1,163.	12/19(5-10Y) 5,252.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	12/15~12/13 54,701.
	12/19(10-25Y) 1,502.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	12/15~12/13 54,701.
		12/ 1~12/ 1 2,464.	12/15~12/13 54,701.
			米ドル資金供給オペ
			1百万ドル
			12/14~12/21 1.
			(12/21~12/28 2.)
			※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
			16,426百万ドル
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.
			12/ 4~12/ 4 3,325.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			2
			12/13~12/22 2.
			国庫短期証券買入額(月初来)
			国債売現先オペ
			1,001
			0
			12/ 6 1,001.
			※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
			43,291
			12/20~12/21 42,098.
			12/20~12/21 1,193.
			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(月初来)
			3,985
			12/12 3,985.
			社債買入額(月初来)
			1,000
			12/19 1,000.
			<12月20日 日銀信用概算(除く買切)>
			共通担保(全)固定 103,843 CP等買入(推定) 25,600
			共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 61,300
			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 30,589 手形売出 0
			貸出増加支援 730,665 国債売現先 0
			供給オペ合計 998,781 国債補完供給 43,291
			貸出(推定) 0 国売現(米ドル担保) 2
			供給額合計 998,781 吸収額合計 43,293
			差し引き 955,488

※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 +0.030000	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 +0.080000	1Y 買気配 -0.020
1M 売気配 -0.020		

## <12月19日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	192,992	+3,992
有担保	23,419	-2,775
無担保	169,573	+6,767

## <12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	-0.010	± 0				-----	-0.205	+0.002
トムネ			-0.009	± 0				-----	-0.162	+0.007
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.030	0.030	-0.015	+0.007				-----	-0.167	+0.001
2週間物	-0.020	0.010	-0.007	-----				-----	-0.245	-0.004
3週間物			0.010	-----				-----	-0.206	+0.001
1ヶ月物				-----				-----	-0.196	-0.007
3ヶ月物			0.025	-----				-----	-0.147	± 0
6ヶ月物				-----				-----	-0.112	± 0
1年物				-----				-----	-0.067	± 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