

東京短資デイリーレポート

2024/12/10

<12月9日のマネタリーベース>

6,528,200

<12月10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	5,283,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,273,900
日銀当座預金残高増減前日比	+10,000

<12月10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		-1,800
財政等要因		-3,900
資金過不足		-5,700
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+7,700
国債補完供給	+5,900	-3,400
金融調節合計		+10,200
当座預金増減-②		+4,500

<12月10日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,278,400
準備預金残高	4,723,600
積み終了先	4,723,500
超過準備	4,723,500
非準備先残高	554,800

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,921,500
今積み期間所要準備額(平均)	130,700
残り要積立額(積数)	100
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	83.3
進捗率乖離幅	+16.6

<12月11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		-1,500
財政等要因		-25,900
資金過不足		-27,400
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+3,400	
金融調節合計		+3,400
当座預金増減		-24,000

<12月11日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残525兆4,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<12月11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	5,299,400	+21,000
+40,000	5,294,400	+16,000
+35,000	5,289,400	+11,000
+30,000	5,284,400	+6,000
+25,000	5,279,400	+1,000
+20,000	5,274,400	-4,000
+15,000	5,269,400	-9,000
+10,000	5,264,400	-14,000
+5,000	5,259,400	-19,000
± 0	5,254,400	-24,000
-5,000	5,249,400	-29,000
-10,000	5,244,400	-34,000
-15,000	5,239,400	-39,000
-20,000	5,234,400	-44,000
-25,000	5,229,400	-49,000
-30,000	5,224,400	-54,000
-35,000	5,219,400	-59,000
-40,000	5,214,400	-64,000
-45,000	5,209,400	-69,000

<12月10日 日銀オペ入札結果>

(10:40) 米ドル資金供給	24/12/12-24/12/19	応札 1ml 落札 1ml	貸付 4.830%
(11:50) 国債補完供給	24/12/10-24/12/11	応札 3,413億 落札 3,413億 全取 -0.050% 平均 -0.050%	
(13:00) 共通担保(全)国	24/12/11-24/12/25	8,000億 応札 24,115億 落札 8,008億	貸付 0.250% 按分 33.2%
(13:50) 国債補完供給	24/12/10-24/12/11	応札 0億 落札 0億	

<12月10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(月初末)	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	
99,226	17,286	成長基盤強化支援資金供給	863	
11/27~12/11 8,005.	12/ 5(-1Y) 1,501.	28,007	857,802	2/17~ 2/17 346.
(12/11~12/25 8,008.)	12/ 5(1-3Y) 3,255.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	12/15~12/13 54,701.	5/17~ 5/12 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	12/ 5(3-5Y) 3,259.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	12/ 5(10-25Y) 1,506.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	6/18~ 6/18 26,498.	8/19~ 8/18 279.
1/10~ 1/10 20,011.	12/10(1-3Y) 3,254.	12/ 1~12/ 1 2,464.	9/15~ 9/12 27,659.	8/18~ 8/18 0.
1/13~ 1/14 20,008.	12/10(5-10Y) 3,758.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	※直近約1年分の期落ち分を記載	11/18~11/17 57.
1/16~ 1/16 20,009.	12/10(25Y-) 753.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	米ドル資金供給オペ	11/17~11/17 0.
1/19~ 1/20 1,163.		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	3百万ドル	2/16~ 2/16 0.
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	12/ 5~12/12 3.	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	(12/12~12/19 1.)	
		成長基盤強化支援米ドル特別		
		9,918百万ドル		
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.		
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.		
		9/ 5~ 9/ 5 1,661.		
		12/ 4~12/ 4 842.		
		国債買現先オペ		
		0		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
			4	
			12/ 4~12/13 4.	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
		国債売現先オペ		
		0		
		※直近約1週間の実施分を記載		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		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		

※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10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	+0.200	1M	-----	3M	買気配 +0.180
1W	売気配 +0.200	2M	-----	6M	買気配 +0.350
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.500
1M	売気配 +0.200				

<12月9日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	119,513	+142
有担保	39,008	-376
無担保	80,505	+518

<12月10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	0.220	0.275	0.227	± 0			0.180	± 0	0.243	± 0
トムネ			0.200	-----				-----	0.247	+0.007
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.390	+0.163				-----	0.226	+0.007
2週間物				-----				-----	0.237	+0.003
3週間物				-----				-----	0.246	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.254	-0.010
3ヶ月物	0.500	0.520	0.510	-----				-----	0.348	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.391	± 0
1年物				-----				-----	0.480	+0.005

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