

東京短資デイリーレポート

2023/9/19

<9月15日のマネタリーベース>

6,690,200

<9月19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	5,473,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,435,300
日銀当座預金残高増減前日比	+38,000

<9月19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	+500
財政等要因	+10,100
資金過不足	+10,600
金融調節	
CP等買入	-300
社債等買入	-1,200
国債補完供給	+27,000
金融調節合計	-6,500
当座預金増減-②	+4,100

<9月19日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,439,400
準備預金残高	4,742,700
積み終了先	4,733,500
超過準備	4,730,700
非準備先残高	696,700

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,882,600
今積み期間所要準備額 (平均)	129,400
残り要積立額 (積数)	51,900
残り要積立額 (平均)	2,000
準備進捗率(%)	98.6
日数進捗率(%)	13.3
進捗率乖離幅	+85.3

<9月20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	+42,800
資金過不足	+43,100
金融調節確定分	
CP等買入	-100
社債等買入	-500
国債補完供給	+32,000
金融調節合計	+31,400
当座預金増減	+74,500

<9月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆3,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.060%~-0.0040% での出合いが中心か。

<9月20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	5,558,900	+119,500
+40,000	5,553,900	+114,500
+35,000	5,548,900	+109,500
+30,000	5,543,900	+104,500
+25,000	5,538,900	+99,500
+20,000	5,533,900	+94,500
+15,000	5,528,900	+89,500
+10,000	5,523,900	+84,500
+5,000	5,518,900	+79,500
± 0	5,513,900	+74,500
-5,000	5,508,900	+69,500
-10,000	5,503,900	+64,500
-15,000	5,498,900	+59,500
-20,000	5,493,900	+54,500
-25,000	5,488,900	+49,500
-30,000	5,483,900	+44,500
-35,000	5,478,900	+39,500
-40,000	5,473,900	+34,500
-45,000	5,468,900	+29,500

<9月19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。

(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 9/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.295%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 9/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.547%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 9/21-23/ 9/28	応札	0m1	落札	0m1	貸付	5.590%
(11:50) 国債補完供給	23/ 9/19-23/ 9/20	応札	32,381億	落札	32,381億	全取	-0.350% 平均 -0.352%
(13:50) 国債補完供給	23/ 9/19-23/ 9/20	応札	2億	落札	2億	全取	-0.350% 平均 -0.350%
(14:00) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 9/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.516%

<9月19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
100,583	42,799	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
9/13~ 9/27 9,362.	9/14(-1Y) 1,504.	45,909	776,646
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/14(1-3Y) 4,251.	12/ 4-12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/14(5-10Y) 6,763.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/10~ 1/10 20,011.	9/14(25Y-) 1,001.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/13~ 1/14 20,008.		9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/16~ 1/16 20,009.		12/ 2-12/ 2 1,712.	
1/19~ 1/20 1,163.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	
		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			米ドル資金供給オペ
			7百万ドル
			9/14~ 9/21 7.
			(9/21~ 9/28 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.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			6
			9/13~ 9/22 6.
			国庫短期証券買入額(月初来)
			国債売現先オペ
			2,002
			9/ 6 1,001.
			9/13 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
			32,383
			9/19~ 9/20 32,381.
			9/19~ 9/20 2.
			ETF買入額
			356,220
			約定 23/ 3/14 701.
			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)
			4,000
			9/13 4,000.
			社債買入額(月初来)
			0
			(9/21 1,000.)
			<9月19日 日銀信用概算(除く買切)>
			共通担保(全)固定 100,583
			CP等買入(推定) 28,200
			共通担保(全)金入 50,026
			社債等買入(推定) 67,300
			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
			成長基盤強化支援 39,647
			貸出増加支援 702,255
			手形売出 0
			新設コロナ企業金融支援 0
			国債売現先 0
			供給オペ合計 956,160
			国債補完供給 32,383
			貸出(推定) 0
			国債売現先(米ドル担保) 6
			供給額合計 956,160
			吸収額合計 32,389
			差し引き 923,771

※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。

<9月19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 -0.140
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M +0.055000	1Y 買気配 -0.020
1M 売気配 -0.020		

<9月15日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	177,470	+11,742
有担保	29,839	+1,148
無担保	147,631	+10,594

<9月19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	-0.059	-0.016					-0.130	-0.016
トムネ									-0.151	-0.030
スポネ										
1週間物									-0.163	-0.036
2週間物			-0.060	-0.006					-0.176	-0.023
3週間物									-0.168	-0.015
1ヶ月物	0.005	0.020	0.013						-0.165	-0.013
3ヶ月物			0.025						-0.139	-0.004
6ヶ月物									-0.125	-0.005
1年物									-0.084	± 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