

# 東京短資テイラーレポート

2023/10/3

## <10月2日のマネタリーベース>

6,708,900
-----------

## <10月3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	5,481,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,455,200
日銀当座預金残高増減前日比	+26,600

## <10月3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		+200
財政等要因		-16,200
資金過不足		-16,000
金融調節		
	期落	新規
国債補充供給	+40,400	-38,000
金融調節合計		+2,400
当座預金増減-②		-13,600

## <10月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,441,600
準備預金残高	4,732,000
積み終了先	4,731,100
超過準備	4,731,100
非準備先残高	709,600

## <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)	2,700
残り要積立額 (平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	60.0
進捗率乖離幅	+39.9

## <10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		0
財政等要因		-68,700
資金過不足		-68,700
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
CP等買入		-100
国債補充供給	+38,000	
金融調節合計		+38,900
当座預金増減		-29,800

## <10月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆1,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.040%~-0.020% での合いが中心か。
---

## <10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	5,456,800	+15,200
+40,000	5,451,800	+10,200
+35,000	5,446,800	+5,200
+30,000	5,441,800	+200
+25,000	5,436,800	-4,800
+20,000	5,431,800	-9,800
+15,000	5,426,800	-14,800
+10,000	5,421,800	-19,800
+5,000	5,416,800	-24,800
± 0	5,411,800	-29,800
-5,000	5,406,800	-34,800
-10,000	5,401,800	-39,800
-15,000	5,396,800	-44,800
-20,000	5,391,800	-49,800
-25,000	5,386,800	-54,800
-30,000	5,381,800	-59,800
-35,000	5,376,800	-64,800
-40,000	5,371,800	-69,800
-45,000	5,366,800	-74,800

## <10月3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)	23/10/ 4	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.230%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/ 4	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.430%
(10:10) 国庫短期証券買	23/10/ 4	1,000億	応札	6,645億	落札	1,001億	最低 +0.010% 平均 +0.013% 按分 61.1%
(10:40) 米ドル資金供給	23/10/ 5-23/10/12	応札	0ml	落札	0ml	貸付	5.580%
(11:50) 国債補充供給	23/10/ 3-23/10/ 4	応札	38,730億	落札	38,730億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給	23/10/ 3-23/10/ 4	応札	0億	落札	0億		

## <10月3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						
9 9,731	3,007	成長基盤強化支援資金供給	1,001						
9/27~10/11	8,510	9/28(3-5Y)	4,508	45,909	776,646	11/19~11/17	0		
1/6~ 1/6	20,014	9/28(5-10Y)	6,756	12/4~12/4	10,258	12/16~12/15	20,601	2/18~ 2/16	0
1/5~ 1/6	20,016	9/28(10-25Y)	2,010	3/4~ 3/4	2,178	3/18~ 3/18	41,458	5/17~ 5/17	0
1/10~ 1/10	20,011	9/28(25Y-)	1,001	6/3~ 6/3	1,950	6/19~ 6/19	63,179	8/19~ 8/19	381
1/13~ 1/14	20,008	9/28(物国)	601	9/2~ 9/2	1,804	9/16~ 9/13	132,310	11/18~11/18	93
1/16~ 1/16	20,009	10/2(5-10Y)	3,007	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
1/19~ 1/20	1,163			3/3~ 3/3	6,793	米ドル資金供給オペ	0百万ドル	5/12~ 5/12	181
				6/2~ 6/2	2,644	9/28-10/ 5	0	8/18~ 8/18	0
				9/1~ 9/1	5,024	※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		
						10/ 4	1,001		
						国債売現先(米ドルオペ用担保)	0		
						国庫短期証券買入額(月初末)	0		
						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		
						国債補充供給	38,730		
						10/3~10/4	38,730		
						10/3~10/4	0		
						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			
						C P買入額(月初末)	0		
						社債買入額(月初末)	0		
						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
						新型コロナウイルス企業金融支援	0	国債売現先	0
						供給オペ合計	955,308	国債補充供給	38,730
						貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
						供給額合計	955,308	吸収額合計	38,730
						差し引き	916,578		

※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。

## <10月3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 -----	1Y 買気配 -0.130
1M 売気配 -0.020		

## <10月2日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	185,184	+42,610
有担保	26,806	+7,112
無担保	158,378	+35,498

## <10月3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	-0.031	+0.013					-0.122	± 0
トムネ				-----					-0.150	-0.019
スポネ				-----						
1週間物	-0.060	-0.025	-0.026	+0.024					-0.162	-0.014
2週間物	-0.029	-0.023	-0.026	+0.012					-0.163	-0.009
3週間物				-----					-0.170	-0.010
1ヶ月物			-0.027	± 0					-0.181	-0.018
3ヶ月物				-----					-0.201	-0.007
6ヶ月物				-----					-0.126	-0.001
1年物				-----					-0.087	-0.002

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