

# 東京短資デイリーレポート

## 2023/10/6

### <10月5日のマネタリーベース>

6,645,600
-----------

### <10月6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	5,422,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,391,800
日銀当座預金残高増減前日比	+30,400

### <10月6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		0
財政等要因		-12,300
資金過不足		-12,300
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-600	
国債補完供給	+41,900	-40,100
金融調節合計		+1,200
当座預金増減-②		-11,100

### <10月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,380,700
準備預金残高	4,714,600
積み終了先	4,714,600
超過準備	4,714,400
非準備先残高	666,100

### <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,887,300
今積み期間所要準備額(平均)	129,600
残り要積立額(積数)	400
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	80.0
進捗率乖離幅	+19.9

### <10月10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		+200
財政等要因		-1,900
資金過不足		-1,700
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)		+10,000
CP等買入	-100	
国債補完供給	+40,100	
金融調節合計		+50,000
当座預金増減		+48,300

### <10月10日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残542兆9,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.060%~-0.030% での合いが中心か。
---

### <10月10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	5,474,000	+93,300
+40,000	5,469,000	+88,300
+35,000	5,464,000	+83,300
+30,000	5,459,000	+78,300
+25,000	5,454,000	+73,300
+20,000	5,449,000	+68,300
+15,000	5,444,000	+63,300
+10,000	5,439,000	+58,300
+5,000	5,434,000	+53,300
± 0	5,429,000	+48,300
-5,000	5,424,000	+43,300
-10,000	5,419,000	+38,300
-15,000	5,414,000	+33,300
-20,000	5,409,000	+28,300
-25,000	5,404,000	+23,300
-30,000	5,399,000	+18,300
-35,000	5,394,000	+13,300
-40,000	5,389,000	+8,300
-45,000	5,384,000	+3,300

### <10月6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)	23/10/10	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.200%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/10	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.410%
(11:50) 国債補完供給	23/10/ 6-23/10/10	応札	40,928億	落札	40,928億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:00) 共通担保(全)入	23/10/10-28/10/10	10,000億	応札	34,190億	落札	10,000億	最低 +0.250% 平均 +0.288% 按分 5.0%
(13:50) 国債補完供給	23/10/ 6-23/10/10	応札	0億	落札	0億		

### <10月6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		
99,731	22,024	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1,001				
9/27-10/11	8,510.	10/ 2(5-10Y)	3,007.	45,909	776,646	11/19-11/17	0.	
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	10/ 5(-1Y)	1,501.	12/ 4-12/ 4	10,258.	12/16-12/15	20,601.	
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	10/ 5(1-3Y)	4,253.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	3/18~ 3/18	41,458.	
1/10~ 1/10	20,011.	10/ 5(3-5Y)	4,501.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	6/19~ 6/19	63,179.	
1/13~ 1/14	20,008.	10/ 5(5-10Y)	6,756.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.	
1/16~ 1/16	20,009.	10/ 5(10-25Y)	2,006.	12/ 2-12/ 2	1,712.	※直近約1年分の期落ち分を記載		
1/19~ 1/20	1,163.			3/ 3~ 3/ 3	6,793.	米ドル資金供給オペ	0	
				6/ 2~ 6/ 2	2,644.	0百万ドル	10/ 5-10/12	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	
						国債売現先(米ドルオペ用担保)	0	
						国庫短期証券買入額(月初来)	1,001	
						国債売現先オペ	0	
						10/ 4	1,001.	
						国債買入額(固定利回)(月初来)	0	
						CP買入額(月初来)	0	
						社債買入額(月初来)	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.	

※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6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 -0.250
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5日のコール市場残高(単位:億円)>

		残高	増減
市場合計		207,889	-4,624
有担保		26,294	-404
無担保		181,595	-4,220

### <10月6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	-0.003	-0.016	-0.001				-----	-0.098	+0.003
トムネ				-----				-----	-0.103	+0.016
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.040	-0.010	-0.031	-0.013				-----	-0.146	+0.004
2週間物				-0.025	-0.010			-----	-0.164	-0.003
3週間物				-----				-----	-0.168	-0.002
1ヶ月物	-0.010	0.250	0.120	-0.130				-----	-0.179	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	-0.200	± 0
6ヶ月物				-----				-----	-0.127	-0.001
1年物				-----				-----	-0.087	± 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