

東京短資デイリーレポート

2023/10/10

<10月6日のマネタリーベース>

6,634,500

<10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	5,429,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,380,700
日銀当座預金残高増減前日比	+48,300

<10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	+200
財政等要因	-5,600
資金過不足	-5,400
金融調節	
共通担保(全店)	期落 新規
CP等買入	-100
国債補充供給	+40,100 -43,200
金融調節合計	+6,800
当座預金増減-②	+1,400

<10月10日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,382,100
準備預金残高	4,722,500
積み終了先	4,722,400
超過準備	4,722,400
非準備先残高	659,600

<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)	300
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	83.3
進捗率乖離幅	+16.6

<10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	+500
財政等要因	-3,800
資金過不足	-3,300
金融調節確定分	
国債買入	期落 新規
共通担保(全店)	-8,500 +6,400
CP等買入	-500
国債補充供給	+43,200
金融調節合計	+54,700
当座預金増減	+51,400

<10月11日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残543兆3,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.050%~-0.030% での合いが中心か。

<10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	5,478,500	+96,400
+40,000	5,473,500	+91,400
+35,000	5,468,500	+86,400
+30,000	5,463,500	+81,400
+25,000	5,458,500	+76,400
+20,000	5,453,500	+71,400
+15,000	5,448,500	+66,400
+10,000	5,443,500	+61,400
+5,000	5,438,500	+56,400
±0	5,433,500	+51,400
-5,000	5,428,500	+46,400
-10,000	5,423,500	+41,400
-15,000	5,418,500	+36,400
-20,000	5,413,500	+31,400
-25,000	5,408,500	+26,400
-30,000	5,403,500	+21,400
-35,000	5,398,500	+16,400
-40,000	5,393,500	+11,400
-45,000	5,388,500	+6,400

<10月10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(1Y-3Y)	23/10/11	4,250億 応札 10,415億 落札 4,253億 最低 -0.008% 平均 -0.006% 按分 2.6%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/10/11	6,750億 応札 14,421億 落札 6,762億 最低 -0.038% 平均 -0.037% 按分 91.7%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/10/11	2,000億 応札 5,294億 落札 2,007億 最低 -0.032% 平均 -0.031% 按分 59.6%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/10/11	1,000億 応札 3,481億 落札 1,005億 最低 -0.032% 平均 -0.031% 按分 56.5%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/11	応札 0億 落札 0億 固定利回較差 +0.202%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/11	応札 0億 落札 0億 固定利回較差 +0.420%
(10:40) ミドル資金供給	23/10/12-23/10/19	応札 0mll 落札 0mll 貸付 5,580%
(11:50) 国債補充供給	23/10/10-23/10/11	応札 44,079億 落札 44,079億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:00) 共通担保(全)固	23/10/11-23/10/25	応札 6,360億 落札 6,360億 貸付 0.000%
(13:50) 国債補充供給	23/10/10-23/10/11	応札 0億 落札 0億

<10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	
99,731	22,024	成長基盤強化支援資金供給	1,001	
9/27-10/11 8,510.	10/ 5(-1Y) 1,501.	45,909	776,646	11/19-11/17 0.
(10/11-10/25 6,360.)	10/ 5(1-3Y) 4,253.	12/ 4-12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.	2/18- 2/16 0.
1/ 5- 1/ 6 20,016.	10/ 5(3-5Y) 4,501.	3/ 4- 3/ 4 2,178.	3/18- 3/18 41,458.	5/17- 5/17 0.
1/ 6- 1/ 6 20,014.	10/ 5(5-10Y) 6,756.	6/ 3- 6/ 3 1,950.	6/19- 6/19 63,179.	8/19- 8/19 381.
1/10- 1/10 20,011.	10/ 5(10-25Y) 2,006.	9/ 2- 9/ 2 1,804.	9/16- 9/13 132,310.	11/18-11/18 93.
1/13- 1/14 20,008.	(10/11(1-3Y) 4,253.)	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.
1/16- 1/16 20,009.	(10/11(5-10Y) 6,762.)	3/ 3- 3/ 3 6,793.	※直近約1年分の期落ち分を記載	5/12- 5/12 181.
1/19- 1/20 1,163.	(10/11(10-25Y) 2,007.)	6/ 2- 6/ 2 2,644.	米ドル資金供給オペ	8/18- 8/18 0.
	(10/11(25Y-) 1,005.)	9/ 1- 9/ 1 5,024.	0百万ドル	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	10/ 5-10/12 0.	
		成長基盤強化支援米ドル特別	(10/12-10/19 0.)	
		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(月初末)	
			国債売現先オペ	
			1,001	
			0	10/ 4 1,001.
			※直近約1週間の実施分を記載	気候変動対応支援資金供給
			国債買入額(固定利回)(月初末)	62,659
			0	1/30- 1/30 28,261.
			国債補充供給	7/21- 7/19 34,398.
			44,079	
			10/10-10/11 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	
			CP買入額(推定)	21,400
			共通担保(金)入	60,032
			社債等買入(推定)	67,400
			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
			貸付増加支援	0
			国債売現先	0
			供給オペ合計	965,314
			国債補充供給	44,079
			貸出(推定)	0
			国債売現先(米ドル担保)	0
			供給額合計	965,314
			吸収額合計	44,079
			差し引き	921,235

※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 0.000	1M -----	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M 0.000000	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.060
1M 売気配 -0.020		

<10月6日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	209,815	+1,926
有担保	26,746	+452
無担保	183,069	+1,474

<10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	-0.087	0.001	-0.030	-0.014					-0.101	-0.003
トムネ									-0.107	-0.004
スポネ										
1週間物	-0.040	0.010	-0.035	-0.004					-0.146	±0
2週間物	-0.050	0.001	-0.047	-0.022					-0.161	+0.003
3週間物									-0.168	±0
1ヶ月物									-0.177	+0.002
3ヶ月物	0.001	0.030	0.016						-0.200	±0
6ヶ月物									-0.126	+0.001
1年物									-0.086	+0.001

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