東京短資デイリーレポート　2023/10/16

＜10月13日のマネタリーベース＞

6,708,300

＜10月16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	5,493,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,454,700
日銀当座預金残高増減前日比	+38,800

＜10月16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		+800
財政等要因		-800
資金過不足		± 0
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補完供給	+37,200	-35,700
金融調節合計		+1,400
当座預金増減-②		+1,400

＜10月16日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高（①+②）	5,456,100
準備預金残高	4,755,100
積み終了先	3,052,700
超過準備	1,336,800
非準預先残高	701,000

＜参考＞

今積み期間所要準備額（積数）	4,006,500
今積み期間所要準備額（平均）	129,200
残り要積立額（積数）	588,200
残り要積立額（平均）	19,600
準預進捗率(%)	85.3
日数進捗率(%)	3.2
進捗率乖離幅	+82.1

＜10月17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		+100
財政等要因		+300
資金過不足		+400
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+16,600
CP等買入		+4,000
国債補完供給	+35,700	
金融調節合計		+56,300
当座預金増減		+56,700

＜10月17日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残551兆2,800億円)で
無担保コール0/Nは-0.025%～-0.015%
での出合いが中心か。

＜10月17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	5,557,800	+101,700
+40,000	5,552,800	+96,700
+35,000	5,547,800	+91,700
+30,000	5,542,800	+86,700
+25,000	5,537,800	+81,700
+20,000	5,532,800	+76,700
+15,000	5,527,800	+71,700
+10,000	5,522,800	+66,700
+5,000	5,517,800	+61,700
± 0	5,512,800	+56,700
-5,000	5,507,800	+51,700
-10,000	5,502,800	+46,700
-15,000	5,497,800	+41,700
-20,000	5,492,800	+36,700
-25,000	5,487,800	+31,700
-30,000	5,482,800	+26,700
-35,000	5,477,800	+21,700
-40,000	5,472,800	+16,700
-45,000	5,467,800	+11,700

＜10月16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)	23/10/17	4,250億	応札	11,428億	落札	4,253億	最低	-0.003%	平均	-0.002%	按分 69.9%
(10:10)	国債買入(3Y-5Y)	23/10/17	4,500億	応札	10,820億	落札	4,505億	最低	-0.007%	平均	-0.005%	按分 48.0%
(10:10)	国債買入(5Y-10Y)	23/10/17	6,750億	応札	11,484億	落札	6,756億	最低	-0.014%	平均	-0.011%	按分 9.4%
(10:10)	国債買入(25Y-)	23/10/17	1,000億	応札	2,748億	落札	1,006億	最低	+0.011%	平均	+0.011%	按分 67.4%
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/10/17		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.242%			
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/10/17		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.476%			
(11:50)	国債補完供給	23/10/16-23/10/17		応札	36,260億	落札	36,260億	全取	-0.350%	平均	-0.351%	
(13:50)	国債補完供給	23/10/16-23/10/17		応札	0億	落札	0億					

＜10月16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
97,581

10/11~10/25	6,360.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.
1/10~ 1/10	20,011.
1/13~ 1/14	20,008.
1/16~ 1/16	20,009.
1/19~ 1/20	1,163.

共通担保(全店)金利入札
60,032

1/24~ 1/24	10,003.
2/ 1~ 2/ 1	10,004.
2/15~ 2/15	10,004.
3/ 1~ 3/ 1	10,010.
9/15~ 9/15	10,005.
10/10~10/10	10,006.

国債補完供給
36,260

10/16~10/17	36,260.
10/16~10/17	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.

国債買入額(月初来)
36,051

10/11(1-3Y)	4,253.
10/11(5-10Y)	6,762.
10/11(10-25Y)	2,007.
10/11(25Y-)	1,005.
(10/17(1-3Y)	4,253.)
(10/17(3-5Y)	4,505.)
(10/17(5-10Y)	6,756.)
(10/17(25Y-)	1,006.)

※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

※直近約1週間の実施分を記載

貸出支援基金の運営として行うオペレーション

成長基盤強化支援資金供給
45,909

12/ 4~12/ 4	10,258.
3/ 4~ 3/ 4	2,178.
6/ 3~ 6/ 3	1,950.
9/ 2~ 9/ 2	1,804.
12/ 2~12/ 2	1,712.
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

成長基盤強化支援米ドル特則
16,708百万ﾄﾞﾙ

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

国債売現先オペ
0

ＣＰ買入額(月初来)
0
(10/17 4,000.)

社債買入額(月初来)
0

貸出増加支援資金供給
776,646

12/16~12/15	20,601.
3/18~ 3/18	41,458.
6/19~ 6/19	63,179.
9/16~ 9/13	132,310.

※直近約1年分の期落ち分を記載

米ドル資金供給オペ
0百万ﾄﾞﾙ

10/12~10/19	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)
2,001

10/ 4	1,001.
10/12	1,000.

被災地金融機関支援資金供給
1,001

11/19~11/17	0.
2/18~ 2/16	0.
5/17~ 5/17	0.
8/19~ 8/19	381.
11/18~11/18	93.
2/17~ 2/17	346.
5/12~ 5/12	181.
8/18~ 8/18	0.

新型コロナ企業金融支援
0

気候変動対応支援資金供給
62,659

1/30~ 1/30	28,261.
7/21~ 7/19	34,398.

＜10月16日　日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	97,581	CP等買入(推定)	20,600
共通担保(全)金入	60,032	社債等買入(推定)	66,200
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		
成長基盤支援	39,647		
貸出増加支援	702,255	手形売出	0
新型コロナ企業金融支援	0	国債売現先	0
供給オペ合計	963,164	国債補完供給	36,260
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	963,164	吸収額合計	36,260
差し引き	926,904		

※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16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 -0.200
1W	売気配 -0.020	2M	+0.040000	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13日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)

	残高	増減
市場合計	193,131	-13,144
有担保	27,607	-767
無担保	165,524	-12,377

＜10月16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	-0.028	-0.009				------	-0.097	+0.004
トムネ				------				------	-0.119	+0.003
スポネ				------				------		
1週間物	-0.045	0.010	-0.026	+0.012				------	-0.145	+0.003
2週間物	-0.030	0.010	-0.024	+0.008				------	-0.161	+0.005
3週間物				------				------	-0.169	+0.008
1ヶ月物	-0.030	-0.020	-0.024	-0.010				------	-0.178	+0.010
3ヶ月物			0.010	-0.008				------	-0.197	+0.002
6ヶ月物				------				------	-0.127	-0.001
1年物				------				------	-0.086	± 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