

# 東京短資デイリーレポート

2023/10/31

## <10月30日のマネタリーベース>

6,779,400
-----------

## <10月31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	5,571,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,523,600
日銀当座預金残高増減前日比	+47,800

## <10月31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		-3,000
資金過不足		-3,000
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-1,800	+4,000
社債等買入	-100	
国債補完供給	+47,400	-53,000
金融調節合計		-3,500
当座預金増減-②		-6,500

## <10月31日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,517,100
準備預金残高	4,803,400
積み終了先	4,802,400
超過準備	4,802,300
非準備先残高	713,700

## <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)	8,400
残り要積立額 (平均)	600
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	51.6
進捗率乖離幅	+48.1

## <11月1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		-900
財政等要因		-29,100
資金過不足		-30,000
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	
国債補完供給	+53,000	
金融調節合計		+52,800
当座預金増減		+22,800

## <11月1日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残553兆9,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.025%~-0.015% での合いが中心か。
---

## <11月1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	5,584,900	+67,800
+40,000	5,579,900	+62,800
+35,000	5,574,900	+57,800
+30,000	5,569,900	+52,800
+25,000	5,564,900	+47,800
+20,000	5,559,900	+42,800
+15,000	5,554,900	+37,800
+10,000	5,549,900	+32,800
+5,000	5,544,900	+27,800
± 0	5,539,900	+22,800
-5,000	5,534,900	+17,800
-10,000	5,529,900	+12,800
-15,000	5,524,900	+7,800
-20,000	5,519,900	+2,800
-25,000	5,514,900	-2,200
-30,000	5,509,900	-7,200
-35,000	5,504,900	-12,200
-40,000	5,499,900	-17,200
-45,000	5,494,900	-22,200

## <10月31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)	23/11/ 1	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.110%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/11/ 1	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.355%
(10:40) ミドル資金供給	23/11/ 2-23/11/ 9	応札	0ml	落札	0ml	貸付	5.580%
(11:50) 国債補完供給	23/10/31-23/11/ 1	応札	54,127億	落札	54,127億	全取	-0.450% 平均 -0.450%
(13:50) 国債補完供給	23/10/31-23/11/ 1	応札	0億	落札	0億		

## <10月31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 8, 2 8 2	9 2, 9 8 3	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
			1, 0 0 1
10/25~11/ 8	10/24(1-3Y)	4 5, 9 0 9	7 7 6, 6 4 6
1/ 6~ 1/ 6	10/24(3-5Y)	12/ 4-12/ 4	10, 258.
1/ 5~ 1/ 6	10/24(5-10Y)	3/ 4~ 3/ 4	2, 178.
1/10~ 1/10	10/24(10-25Y)	6/ 3~ 6/ 3	1, 950.
1/13~ 1/14	10/25(5-10Y)	9/ 2~ 9/ 2	1, 804.
1/16~ 1/16	10/25(10-25Y)	12/ 2-12/ 2	1, 712.
1/19~ 1/20	10/30(3-5Y)	3/ 3~ 3/ 3	6, 793.
	10/30(5-10Y)	6/ 2~ 6/ 2	2, 644.
	10/30(10-25Y)	9/ 1~ 9/ 1	5, 024.
	10/30(25Y-)		1, 001.
	10/30(物国)		602.
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			成長基盤強化支援ドル特別
			1 6, 7 0 8 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
			4, 0 0 5
			10/ 4
			1, 001.
			10/12
			1, 000.
			10/18
			1, 001.
			10/25
			1, 003.
			気候変動対応支援資金供給
			6 2, 6 5 9
			1/30~ 1/30
			28, 261.
			7/21~ 7/19
			34, 398.
			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
			新型コロナ企業金融支援
			0
			国債売現先
			0
			供給オペ合計
			973, 868
			国債補完供給
			54, 127
			貸出(推定)
			0
			国債売現先(米ドル担保)
			0
			供給額合計
			973, 868
			吸収額合計
			54, 127
			差し引き
			919, 741

※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31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 +0.001000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M +0.010000	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30日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	183,872	-167
有担保	26,205	-1,300
無担保	157,667	+1,133

## <10月31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	-0.020	-0.004					-0.270	-0.138
トムネ				-----					-0.179	+0.002
スポネ				-----						
1週間物	-0.025	-0.015	-0.022	± 0					-0.169	-0.003
2週間物				-----					-0.169	-0.002
3週間物			-0.015	-----					-0.169	± 0
1ヶ月物	-0.001	0.000	-0.001	-----					-0.183	-0.009
3ヶ月物				-----					-0.192	+0.001
6ヶ月物				-----					-0.118	± 0
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