東京短資デイリーレポート

2024/9/17

<9月13日のマネタリーベース>

6,660,000

<9月17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	高 5,440,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,418,400
日銀当座預金残高増減前日上	上 +22,000

<9月17日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

Π:	資金需給実績			
	銀行券要因			+200
	財政等要因			+8,700
ш	資金過不足			+8,900
	金融調節			,
		期	落	新規
ш	CP等買入		-100	
ш	国債補完供給	+14	,500	-19,800
	金融調節合計			-5,400

<9月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,421,900
準備預金残高	4,876,500
積み終了先	4,796,500
超過準備	4,496,300
非準預先残高	545,400

<参考>

ヽ゚ヺ゚ヺ ゙゙゙゙゙	
今積み期間所要準備額(積数)	3,940,700
今積み期間所要準備額(平均)	131,400
残り要積立額(積数)	82,600
残り要積立額(平均)	3,000
準預進捗率(%)	97.9
日数進捗率(%)	6.7
進捗率乖離幅	+91.2

<9月18日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

_	7月10日ツロ戦ヨ圧沢亚	日 //以 3	女囚し	1位 四本間 1位
П	資金需給予想			
П	銀行券要因			+400
ш	財政等要因			+6,600
ш	資金過不足			+7,000
lГ	金融調節確定分			
		期	落	新規
ш	共通担保(全店)	-8	,000	+8,000
ш	CP等買入		-100	
ш	国債補完供給	+19	,800	
	金融調節合計			+19,700
	当座預金増減			+26,700

<9月18日のオペ予想>

<3月10日の4个予芯/
朝一の金融調節はノーオペ
(当預残544兆8,600億円)で
無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228%
での出合いが中心か。

<9月18日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9月18日9時20分	のオペによる日	銀当座預金状況
9時20分の	日銀当座	前日比
オペ	預金残高	増減
+45,000	5,493,600	+71,700
+40,000	5,488,600	+66,700
+35,000	5,483,600	+61,700
+30,000	5,478,600	+56,700
+25,000	5,473,600	+51,700
+20,000	5,468,600	+46,700
+15,000	5,463,600	+41,700
+10,000	5,458,600	+36,700
+5,000	5,453,600	+31,700
<u>± 0</u>	5,448,600	+26,700
-5,000	5,443,600	+21,700
-10,000	5,438,600	+16,700
-15,000	5,433,600	+11,700
-20,000	5,428,600	+6,700
-25,000	5,423,600	+1,700
-30,000	5,418,600	-3,300
-35,000	5,413,600	-8,300
-40,000	5,408,600	-13,300
-45,000	5,403,600	-18,300

<9月17日 日銀オペ人礼料	信果> ※スペースの[関係上、内容	を省略	する場合があり	ります。詳 終	flは弊社HP	をご参照くた	ださい。			
(10:40) 社債買入	24/ 9/20	500億	応札	1,245億 落	轼 50	0億 最但	+0.597%	平均	+0.618%	按分	39.2%
(10:40) 米ドル資金供給	24/ 9/19-24/ 9/26		応札	2mil 落	抖 2	mil		貸付	5.230%		
(11:50) 国債補完供給	24/ 9/17-24/ 9/18		応札	20,262億 落	科 20,26	2億 全取	-0.050%	平均	-0.050%		
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 9/18-24/10/ 2	8,000億	応札	13,152億 落	科 8,00	6億		貸付	0.250%	按分	60.9%
(13:50) 国債補完供給	24/ 9/17-24/ 9/18		応札	0億 落	札	0億					
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	24/ 9/18-24/ 9/27	5,000億	応札	4億 落	札	4億 全取	+0.220%	平均	+0.220%		
				•							

英語程係(全店) 画和人利	∠0日17日 夕ナ∾ 球草	マカヤン /ホーーナ/エ	# D # 3 2	1×+1120+=0+101 TB)	
9 9 2 2 5 5 9 7 7 0 4 0 成長基盤僧化支援資金供給 1 2 11/18-11/18 93					************************************
9/4 - 9/18					
(9/18-10/2 8,006.) 9/12(3-5V) 3,752. 12/2-12/2 1,712. 12/15-12/13 54,701. 2/17~2/17 346. 1/6~1/6~2 0,014. 1/6~1/6~2 0,014. 1/6~1/6~2 0,014. 1/6~1/6~2 0,014. 1/10~1/10~20,008. 1/10~1/10~20,008. 1/10~1/10~20,009. 1/10~1/10~1/10~20,009. 1/10~1/10~1/10~1/10~1/10~1/10~1/10~1/10					
1/5 - 1/6					, ,
1/6 - 1 / 6 20,014 9/12 (25Y -) 753 6 / 2 - 6 / 2 2,644 6/18 - 6/18 26,498 8/19 - 8/18 279 1/13 - 1/14 20,008 1/16 - 1/16 20,009 1/19 - 1/20 1,163 1/19 - 1/20 1/19 - 1/20 1,163 1/19 - 1/20 1/19 - 1/20 1,163 1/19 - 1/20 1/19 - 1/20 1,163 1/19 - 1/20 1/19 - 1/20 1,163 1/19 - 1/20	(9/18~10/ 2 8,006.)		12/ 2~12/ 2 1,712.		
1/10-1/10 20,011.	1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/12(5-10Y) 4,008.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008	1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/12(25Y-) 753.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12 181.
1/16-1/16 20,009.	1/10~ 1/10 20,011.		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.	8/19~ 8/18 279.
1/19-1/20	1/13~ 1/14 20,008.		12/ 1~12/ 1 2,464.		8/18~ 8/18 0.
12 / 4-12 / 4 3,325. 1百万ト ル 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 9/12-	1/16~ 1/16 20,009.		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	※直近約1年分の期落ち分を記載	11/17~11/17 0.
12 / 4-12 / 4 3,325. 1百万ト ル 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 1. 9/12-9/19 1. 9/12-	1/19~ 1/20 1.163.		6/3~6/3 3.160.	米ドル資金供給オペ	2/16~ 2/16 0.
大通担保(全店)金利入札	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,				, , , ,
大通担保(全店)金利入札			12, 12, 1 0,0201		
大通担保(全店)金利入札			※直诉約1年分の期落ち分を記載	-, -, -	
12,401百万ドル				(3/13 3/20 2.)	
共通担保(全店)金利入札					
大通担保(全店)金利入札			,		信候 变動対広古埋资 今 供炒
1/30~ 1/30 47,268. 1/30~ 1/30 47,268. 1/30~ 1/30 47,268. 7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 47,268. 1/30~ 1/30	+ 海中伊(今庄)今利 3 村		, , , ,		
1/24~ 1/24			l ' ' '		
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 10/25~10/25 10,003 10/25~10/25 10,003 国債補完供給			l ' ' '		, ,
国債買現先才ペ	' '		9/ 5~ 9/ 5 1,661.		1/19~ 1/18 12,361.
○ 国債売現先(米ドルオペ用担保)			同信冊刊先上。		
3/15~9/15 10,005.	' '				
10/10~10/10			0		
Total					
国庫短期証券買入額(月初来)				(9/18~ 9/27 4.)	
国債売現先オペ	10/25~10/25 10,003.				
**適近約1週間の実施分を記載				国庫短期証券買入額(月初来)	
国債爾元(国定利回)(月初来) 国債補完供給 20,262 9/17~9/18 20,262. 9/17~9/18 0. CP買入額(月初来) の CSP買入額(月初来) の CSP買入額(月初来) の CSP買入額(月初来) の CSP用7日 日銀信用概算(除く買切)> 共通担保(金)固定 99,225 (P等買入(推定) 19,900 技通担保(金)金入 70,035 社債等買入(推定) 55,900 国債買現先 の 被災地金融側支援 899 気候変動対応支援 119,626 成長基盤支援 25,272 手形売出 の 貸出増加支援 783,814 国債売現先 の			国債売現先オペ	0	
□ 国債補完供給		※直近約1週間の実施分を記載	0		
国債補完供給 2 0 , 2 6 2 9/17~ 9/18 20,262. 9/17~ 9/18 0. C P買入額(月初来) O SP月17日 日銀信用概算(除く買切)> 共通担保(全)固定 99,225 [P等買入(推定) 19,900 社債等買入(推定) 55,900 国債買現先 0 被災地金融機関支援 899 気候変動対応支援 119,626 成長基盤支援 25,272 手形売出 0 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0		国債買入額(固定利回)(月初来)			
2 0, 2 6 2 9/17~ 9/18 20,262. 9/17~ 9/18 0. C P買入額(月初来) C P買入額(月初来) C P買入額(月初来) C P買入額(全量) C P買入額(自初来) 上通担保(全)固定 99,225 [P等買入(推定) 19,900 上通担保(全)金入 70,035 上值等買入(推定) 55,900 国債買現先 0 社債買入額(月初来) 大力(東京) 20,262 29,272 [P等買入(推定) 19,900 上通担保(全)金入 70,035 上值等買入(推定) 55,900 国債買現先 0 20,272 20,272 [P形売出 0) 20,282 25,272 [F形売出 0) 20,282 25,272 [F形売出 0) 20,283 25,272 [F形売出 0) 20,284 25,272 [F形売出 0) 20,284 25,272 [F形売出 0) 20,285 25,272 [F形売出 0) 20,285 25,272 [F形売出 0) 20,286 25,272 [F形売出 0) 20,286 25,272 [F下売出 0) 20,286 25,272 [F下売出 0) 20,286 25,272 [F下売出 0) 20,287 25,272 [F下売出 0) 20,287 25,272 [F下売出 0) 20,288 25,272 [F下売出 0) 20,289 25,272 [F下売品 0) 20,289 25,272 [0			
2 0, 2 6 2 9/17~ 9/18 20,262. 9/17~ 9/18 0. C P買入額(月初来) C P買入額(月初来) C P買入額(月初来) C P買入額(全) C P買入額(全) C P買入額(自初来) 大通担保(全) 固定	国債補完供給				
S () () () () () () () () () (
9/17~ 9/18 0. C 9月17日 日銀信用概算(除く買切)> 共通担保(全)固定 99,225 (P等買入(推定) 19,900 共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 55,900 直債買現先 0 被災地金融機関支援 899 が定 23/10/4 701. 社債買入額(月初来) ETF買入額(企業支援) 1 4 , 6 2 8 (9/20 500.) (9/20 500.)			CP買入額(月初来)		
〈9月17日 日銀信用概算(除〈買切)〉 共通担保(全)固定 99,225 (P等買入(推定) 19,900 共通担保(全)盈元 70,035 社債等買入(推定) 55,900 国債買現先 0 被災地金融機関支援 899 (23/10/4 701. とTF買入額(企業支援) 0 気候変動対応支援 119,626 成長基盤支援 25,272 手形売出 0 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0	' '				
ETF買入額 社債買入額(月初来) 3 5 6 , 9 2 1 対定 23/10/4 701. ETF買入額(企業支援) 0 1 4 , 6 2 8 (9/20 500.) 共通担保(全)固定 99,225 (P等買入(推定) 19,900 共通担保(全)盈入 70,035 社債等買入(推定) 55,900 極災地金融機関支援 899 会員 大債買入額(月初来) 気候変動対応支援 119,626 成長基盤支援 25,272 手形売出 0 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0	, , ,			<9月17日 日銀信用	概算(除く買切)>
ETF買入額 工持選担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 55,900 国債買現先 0 被災地金融機関支援 899 気候変動対応支援 119,626 成長基盤支援 25,272 手形売出 0 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0				共通担保(全)固定 99 225	CP等買入(推定) 19 900
ETF買入額 国債買現先 0 3 5 6 , 9 2 1 約定 23/10/4 701. 社債買入額(月初来) ETF買入額(企業支援) 0 成長基盤支援 25,272 手形売出 0 1 4 , 6 2 8 (9/20 500.) 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0					
356,921 被災地金融機関支援 899 約定23/10/4701. 社債買入額(月初来) ETF買入額(企業支援) 0 成長基盤支援 25,272 手形売出 0 14,628 (9/20 500.) 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0	FTF買 λ 頦				
約定 23/10/4 701. ETF買入額(企業支援) 0 1 4 , 6 2 8 (9/20 (9/20 500.) 賞出増加支援/783,814 国債売現先 0 (10/20					_
ETF買入額企業支援) 0 成長基盤支援 25,272 手形売出 0 1 4 , 6 2 8 (9/20 500.) 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0			計構置λ額(日知本)		
14,628 (9/20 500.) 貸出増加支援 783,814 国債売現先 0					
並ん 21/ 3/31 12.			(3/20 500.)		
	, ,				
J-REIT買入額 (費出(推定) 0 国売現(米ドル担保) 0 (供給) 第0 売目 1 20 2023 2023				貝山(推正) (世紀)	
供給額合計 1,098,871 吸収額合計 20,262					
約定 22/ 6/14 12. ※直近約1週間の実施分を記載 差し引き 1,078,609	約定 22/ 6/14 12.	※直近約1週間の実施分を記載		<u> </u>	1,078,609

※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。

<9月17日のオープン市場気配レート(単位:%)>

		3 T I I V/ V/ V / V	اللاسدار	X100 P 1 (+)	4.70					
NCD/CP現先 CPプライマリ				TE	3アウトライト	∢	<9月13日の	1-ル市場残高(単位:億円)	
	S/N	売気配 +0.200	1所員	気配 +0.26000	03M	買気配 +0.130			残高	増減
	1W	売気配 +0.200	2M		6M	買気配 +0.150		市場合計	120,728	+2,107
	2W	売気配 +0.200	3M		1Y	買気配 +0.150		有担保	40,337	+956
	1 M	売気配 +0.200						無扣保	80.391	+1 151

→3/11/1	<u> </u>											
	無担保コール					有担保コール				ドレート		
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均值	前日比		
翌日物	0.215	0.275	0.228	+0.001					0.248	+0.004		
トムネ									0.245	+0.002		
スポネ												
1週間物			0.390	+0.163					0.206	+0.005		
2週間物									0.197	-0.001		
3週間物									0.197	± 0		
1ヶ月物			0.320	-0.068					0.198	± 0		
3ヶ月物			0.340						0.203	± 0		
6ヶ月物									0.252	+0.001		
1年物									0.318	+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