

東京短資デイリーレポート

2024/10/7

<10月4日のマネタリーベース>

6,640,900

<10月7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	5,417,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,400,500
日銀当座預金残高増減前日比	+16,500

<10月7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		+400
財政等要因		+2,200
資金過不足		+2,600
金融調節		
国債補完供給	+11,200	-11,100
金融調節合計		+100
当座預金増減-②		+2,700

<10月7日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,403,200
準備預金残高	4,840,700
積み終了先	4,840,700
超過準備	4,840,700
非準備先残高	562,500

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,924,400
今積み期間所要準備額 (平均)	130,800
残り要積立額 (積数)	400
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	73.3
進捗率乖離幅	+26.6

<10月8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		-4,500
資金過不足		-4,400
金融調節確定分		
国債買入		+11,700
CP等買入		-200
国債補完供給	+11,100	
金融調節合計		+22,600
当座預金増減		+18,200

<10月8日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残542兆1,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での出合いが中心か。
--

<10月8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	5,466,400	+63,200
+40,000	5,461,400	+58,200
+35,000	5,456,400	+53,200
+30,000	5,451,400	+48,200
+25,000	5,446,400	+43,200
+20,000	5,441,400	+38,200
+15,000	5,436,400	+33,200
+10,000	5,431,400	+28,200
+5,000	5,426,400	+23,200
± 0	5,421,400	+18,200
-5,000	5,416,400	+13,200
-10,000	5,411,400	+8,200
-15,000	5,406,400	+3,200
-20,000	5,401,400	-1,800
-25,000	5,396,400	-6,800
-30,000	5,391,400	-11,800
-35,000	5,386,400	-16,800
-40,000	5,381,400	-21,800
-45,000	5,376,400	-26,800

<10月7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)	24/10/ 8	3,250億	応札 11,128億	落札 3,256億	最低 +0.021%	平均 +0.022%	按分 7.5%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/10/ 8	3,250億	応札 13,375億	落札 3,252億	最低 +0.029%	平均 +0.032%	按分 18.4%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/10/ 8	3,750億	応札 9,127億	落札 3,758億	最低 +0.027%	平均 +0.029%	按分 84.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/10/ 8	1,500億	応札 2,955億	落札 1,503億	最低 +0.035%	平均 +0.040%	按分 20.5%
(11:50) 国債補完供給	24/10/ 7-24/10/ 8		応札 11,424億	落札 11,424億	全取 -0.050%	平均 -0.050%	
(13:50) 国債補完供給	24/10/ 7-24/10/ 8		応札 4億	落札 4億	全取 -0.050%	平均 -0.050%	

<10月7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
9,227	8,770	成長基盤強化支援資金供給	899
		貸出増加支援資金供給	899
10/ 2~10/16	8,006.	29,719	857,802
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	12/ 2~12/ 2	1,712.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	12/15~12/13	54,701.
1/10~ 1/10	20,011.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.
1/13~ 1/14	20,008.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.
1/16~ 1/16	20,009.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.
1/19~ 1/20	1,163.	12/ 1~12/ 1	2,464.
		3/ 2~ 3/ 2	7,922.
		6/ 3~ 6/ 3	3,160.
		12/ 4~12/ 4	3,325.
		※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	
		12,401百万ドル	
		12/ 4~12/ 4	3,325.
		3/ 4~ 3/ 4	2,097.
		6/ 3~ 6/ 3	5,318.
		9/ 5~ 9/ 5	1,661.
		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)	
		0	
		国債売現先オペ	
		0	
		C P買入額(月初末)	
		0	
		社債買入額(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	

<10月7日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,227	CP等買入(推定)	19,000
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	55,000
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	25,566	手形売出	0
貸出増加支援	783,814	国債売現先	0
供給オペ合計	1,099,167	国債補完供給	11,428
貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
供給額合計	1,099,167	吸収額合計	11,428
		差し引き	1,087,739

※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7日のオープン市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP現先	CPプライマリー	TBアウトライト			
S/N	+0.200	1M	+0.270000	3M	買気配 +0.150
1W	売気配 +0.200	2M	-----	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.200				

<10月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	112,016	+2,780
有担保	37,758	-1,417
無担保	74,258	+4,197

<10月7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	0.220	0.227	0.227	± 0				-----	0.233	-0.008
トムネ				-----				-----	0.233	-0.007
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.226	-----				-----	0.201	± 0
2週間物	0.227	0.280	0.232	-----				-----	0.200	± 0
3週間物				-----				-----	0.200	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.201	+0.001
3ヶ月物	0.330	0.350	0.343	-----				-----	0.209	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.251	-0.001
1年物				-----				-----	0.317	-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