

東京短資デイリーレポート

2023/9/4

<9月1日のマナリーベース>

6,699,300

<9月4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	5,450,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,440,600
日銀当座預金残高増減前日比	+10,100

<9月4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	+1,000	
財政等要因	-24,400	
資金過不足	-23,400	
金融調節		
CP等買入	期落	新規
社債等買入	-500	
国債補完供給	+32,900	-35,400
金融調節合計		-3,100
当座預金増減-②		-26,500

<9月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,414,100
準備預金残高	4,723,300
積み終了先	4,721,700
超過準備	4,721,700
非準備先残高	690,800

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,009,600
今積み期間所要準備額(平均)	129,300
残り要積立額(積数)	4,000
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	64.5
進捗率乖離幅	+35.4

<9月5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	+600	
財政等要因	-300	
資金過不足	+300	
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
CP等買入	-300	
国債補完供給	+35,400	
金融調節合計		+46,500
当座預金増減		+46,800

<9月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆900億円)で 無担保コール0/Nは-0.085%~-0.065% での合いが中心か。

<9月5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	5,505,900	+91,800
+40,000	5,500,900	+86,800
+35,000	5,495,900	+81,800
+30,000	5,490,900	+76,800
+25,000	5,485,900	+71,800
+20,000	5,480,900	+66,800
+15,000	5,475,900	+61,800
+10,000	5,470,900	+56,800
+5,000	5,465,900	+51,800
±0	5,460,900	+46,800
-5,000	5,455,900	+41,800
-10,000	5,450,900	+36,800
-15,000	5,445,900	+31,800
-20,000	5,440,900	+26,800
-25,000	5,435,900	+21,800
-30,000	5,430,900	+16,800
-35,000	5,425,900	+11,800
-40,000	5,420,900	+6,800
-45,000	5,415,900	+1,800

<9月4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/ 9/ 5	4,250億 応札 6,725億 落札 4,250億 最低 -0.002% 平均 0.000% 按分 72.4%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 9/ 5	4,500億 応札 7,524億 落札 4,501億 最低 +0.002% 平均 +0.010% 按分 4.3%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 9/ 5	2,000億 応札 4,483億 落札 2,004億 最低 +0.025% 平均 +0.027% 按分 80.3%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/ 9/ 5	1,000億 応札 1,458億 落札 1,001億 最低 +0.020% 平均 +0.026% 按分 57.5%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/ 5	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.375%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/ 5	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.620%
(11:50) 国債補完供給	23/ 9/ 4-23/ 9/ 5	応札 35,762億 落札 35,762億 全取 -0.450% 平均 -0.450%
(13:50) 国債補完供給	23/ 9/ 4-23/ 9/ 5	応札 0億 落札 0億
(14:00) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/ 5	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.590%

<9月4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	
100,052	0	成長基盤強化支援資金供給	1,001	
8/30~ 9/13 8,831.	8/31(3-5Y) 4,505.	45,909	754,212	11/19-11/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	8/31(5-10Y) 6,758.	12/ 4-12/ 4 10,258.	9/17~ 9/15 13,014.	2/18~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	8/31(10-25Y) 2,004.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	12/16-12/15 20,601.	5/17~ 5/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	8/31(25Y-) 1,003.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	3/18~ 3/18 41,458.	8/19~ 8/19 381.
1/13~ 1/14 20,008.	8/31(物国) 600.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18-11/18 93.
1/16~ 1/16 20,009.	(9/ 5(1-3Y) 4,250.)	12/ 2-12/ 2 1,712.		2/17~ 2/17 346.
1/19~ 1/20 1,163.	(9/ 5(3-5Y) 4,501.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
	(9/ 5(10-25Y) 2,004.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
	(9/ 5(25Y-) 1,001.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			8/31~ 9/ 7 0.	
			※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	
			17,427百万ドル	
			9/ 2~ 9/ 5 6,101.	
			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)	
			0	
			国債売現先オペ	
			0	
			※直近約1週間の実施分を記載	
			国債買入額(固定利回)(月初末)	
			0	
			国債補完供給	
			35,762	
			9/ 4~ 9/ 5 35,762.	
			9/ 4~ 9/ 5 0.	
			C P買入額(月初末)	
			0	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			共通担保(全店)固定金利	
			100,052	
			CP等買入(推定)	27,300
			共通担保(全)金入	40,021
			社債等買入(推定)	70,000
			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	41,483
			貸出増加支援	683,578
			手形売	0
			新設コロナ企業金融支援	0
			国債売現先	0
			供給オペ合計	928,783
			国債補完供給	35,762
			貸出(推定)	0
			国売現(米ドル担保)	0
			供給額合計	928,783
			吸収額合計	35,762
			差し引き	893,021

※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4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 0.000000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.100
2W 売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.090
1M 売気配 -0.020		

<9月1日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	199,654	+9,930
有担保	24,613	-2,716
無担保	175,041	+12,646

<9月4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	-0.069	-0.009					-0.107	+0.041
トムネ			-0.060	-----					-0.114	+0.038
スポネ				-----						
1週間物			-0.038	-0.005					-0.135	+0.020
2週間物	-0.068	0.030	-0.049	-0.014					-0.137	+0.020
3週間物			0.001	±0					-0.142	+0.016
1ヶ月物	0.005	0.150	0.027	-----					-0.160	+0.005
3ヶ月物				-----					-0.141	+0.002
6ヶ月物				-----					-0.124	-0.001
1年物				-----					-0.093	-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