

# 東京短資デイリーレポート

2023/10/2

## <9月29日のマナタリーベース>

6,726,100
-----------

## <10月2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	5,500,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,472,000
日銀当座預金残高増減前日比	+28,700

## <10月2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	-28,000	
資金過不足	-27,600	
金融調節		
国債買入	期落	新規
		+3,000
CP等買入	-200	
国債補充供給	+48,400	-40,400
金融調節合計		+10,800
当座預金増減-②		-16,800

## <10月2日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,455,200
準備預金残高	4,759,800
積み終了先	4,759,100
超過準備	4,759,100
非準備先残高	695,400

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,882,600
今積み期間所要準備額 (平均)	129,400
残り要積立額 (積数)	3,600
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	56.7
進捗率乖離幅	+43.2

## <10月3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	+200	
財政等要因	-14,000	
資金過不足	-13,800	
金融調節確定分		
国債補充供給	期落	新規
	+40,400	
金融調節合計		+40,400
当座預金増減		+26,600

## <10月3日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆1,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.050%~-0.030% での出合いが中心か。
--

## <10月3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	5,526,800	+71,600
+40,000	5,521,800	+66,600
+35,000	5,516,800	+61,600
+30,000	5,511,800	+56,600
+25,000	5,506,800	+51,600
+20,000	5,501,800	+46,600
+15,000	5,496,800	+41,600
+10,000	5,491,800	+36,600
+5,000	5,486,800	+31,600
±0	5,481,800	+26,600
-5,000	5,476,800	+21,600
-10,000	5,471,800	+16,600
-15,000	5,466,800	+11,600
-20,000	5,461,800	+6,600
-25,000	5,456,800	+1,600
-30,000	5,451,800	-3,400
-35,000	5,446,800	-8,400
-40,000	5,441,800	-13,400
-45,000	5,436,800	-18,400

## <10月2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)	23/10/ 3	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.235%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/ 3	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.440%
(11:50) 国債補充供給	23/10/ 2-23/10/ 3	応札	41,126億	落札	41,126億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給	23/10/ 2-23/10/ 3	応札	0億	落札	0億		

## <10月2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				
99,731	3,007	成長基盤強化支援資金供給	1,001				
9/27-10/11	8,510	45,909	776,646	11/19-11/17	0		
1/ 6~ 1/ 6	20,014	12/ 4-12/ 4	10,258	12/16-12/15	20,601	2/18~ 2/16	0
1/ 5~ 1/ 6	10,016	9/28(5-10Y)	6,756	3/18~ 3/18	41,458	5/17~ 5/17	0
1/10~ 1/10	20,011	9/28(10-25Y)	2,010	6/19~ 6/19	63,179	8/19~ 8/19	381
1/13~ 1/14	20,008	9/28(25Y-)	1,001	9/16~ 9/13	132,310	11/18-11/18	93
1/16~ 1/16	20,009	9/28(物国)	601	12/ 2-12/ 2	1,712	2/17~ 2/17	346
1/19~ 1/20	1,163	10/ 2(5-10Y)	3,007	3/ 3~ 3/ 3	6,793	5/12~ 5/12	181
		6/ 2~ 6/ 2	2,644	9/ 1~ 9/ 1	5,024	8/18~ 8/18	0
		9/ 1~ 9/ 1	5,024				
		※直近約1年分の期落ち分を記載		9/28-10/ 5	0		
		成長基盤強化支援ドル特別					
		16,708百万ドル					
		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					
		国債補充供給					
		41,126					
		10/ 2~10/ 3	41,126				
		10/ 2~10/ 3	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)金利入札					
		50,026					
		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				
		C P買入額(月初末)					
		0					
		社債買入額(月初末)					
		0					
		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					
		供給オペ合計					
		955,308					
		国債補充供給					
		41,126					
		貸出(推定)					
		0					
		国債売現先(米ドル担保)					
		0					
		供給額合計					
		955,308					
		吸収額合計					
		41,126					
		差し引き					
		914,182					

※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2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 -0.140
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.020
1M	売気配 -0.020				

## <9月29日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	142,574	-95,116
有担保	19,694	-2,201
無担保	122,880	-92,915

## <10月2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	-0.044	+0.018				-----	-0.122	+0.429
トムネ				-----				-----	-0.131	+0.004
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.060	-0.013	-0.050	-0.009				-----	-0.148	-0.009
2週間物	-0.058	0.030	-0.038	+0.002				-----	-0.154	+0.002
3週間物			-0.045	-----				-----	-0.160	-0.001
1ヶ月物	-0.045	0.000	-0.027	-0.041				-----	-0.163	-0.008
3ヶ月物			0.030	-----				-----	-0.194	-0.012
6ヶ月物				-----				-----	-0.125	-0.001
1年物				-----				-----	-0.085	-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