

東京短資デイリーレポート

2023/10/17

<10月16日のマネタリーベース>

6,708,900

<10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	5,512,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,456,100
日銀当座預金残高増減前日比	+56,700

<10月17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		+100
財政等要因		+800
資金過不足		+900
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+16,600
CP等買入		+4,000
国債補充供給	+35,700	-35,000
金融調節合計		+21,300
当座預金増減-②		+22,200

<10月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,478,300
準備預金残高	4,768,400
積み終了先	4,690,600
超過準備	4,283,900
非準備先残高	709,900

<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)	99,200
残り要積立額 (平均)	3,400
準備進捗率(%)	97.5
日数進捗率(%)	6.5
進捗率乖離幅	+91.0

<10月18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		-400
財政等要因		-9,100
資金過不足		-9,500
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
CP等買入	-100	
社債等買入	-300	
国債補充供給	+35,000	
金融調節合計		+35,600
当座預金増減		+26,100

<10月18日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残550兆4,400億円)で無担保コール0/Nは-0.025%~-0.015%での合いが中心か。
--

<10月18日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,549,400	+71,100
+40,000	5,544,400	+66,100
+35,000	5,539,400	+61,100
+30,000	5,534,400	+56,100
+25,000	5,529,400	+51,100
+20,000	5,524,400	+46,100
+15,000	5,519,400	+41,100
+10,000	5,514,400	+36,100
+5,000	5,509,400	+31,100
± 0	5,504,400	+26,100
-5,000	5,499,400	+21,100
-10,000	5,494,400	+16,100
-15,000	5,489,400	+11,100
-20,000	5,484,400	+6,100
-25,000	5,479,400	+1,100
-30,000	5,474,400	-3,900
-35,000	5,469,400	-8,900
-40,000	5,464,400	-13,900
-45,000	5,459,400	-18,900

<10月17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)	23/10/18	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.250%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/18	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.485%
(10:10) 国庫短期証券買入	23/10/18	1,000億	応札	6,017億	落札	1,001億	最低 +0.017% 平均 +0.021% 按分 92.2%
(10:40) ミドル資金供給	23/10/19-23/10/26	応札	3mil	落札	3mil	貸付	5.580%
(11:50) 国債補充供給	23/10/17-23/10/18	応札	35,552億	落札	35,552億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給	23/10/17-23/10/18	応札	0億	落札	0億		

<10月17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 7, 5 8 1	5 2, 5 7 1	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
10/11-10/25	6,360.	12/ 4-12/ 4	10,258.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	12/16-12/15	20,601.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	3/18~ 3/18	41,458.
1/10~ 1/10	20,011.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.
1/13~ 1/14	20,008.	6/19~ 6/19	63,179.
1/16~ 1/16	20,009.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.
1/19~ 1/20	1,163.	12/ 2-12/ 2	1,712.
		3/ 3~ 3/ 3	6,793.
		6/ 2~ 6/ 2	2,644.
		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	
		10/12-10/19	0.
		(10/19-10/26	3.)
		※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	
		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.
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売入先(米ドルオペ用担保)	
		0	
		国庫短期証券買入額(月初末)	
		国債売入先オペ	
		10/ 4	1,001.
		10/12	1,000.
		(10/18	1,001.)
		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.
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売入先オペ	
		2, 0 0 1	
		※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	
		3 5, 5 5 2	
		10/17-10/18	35,552.
		10/17-10/18	0.
		ETF買入額	
		3 5 6, 9 2 1	
		約定 23/10/ 4	701.
		ETF買入額(企業支援)	
		1 4, 6 2 8	
		約定 21/ 3/31	12.
		J-REIT買入額	
		6, 8 2 3	
		約定 22/ 6/14	12.
		※直近約1週間の実施分を記載	
		C P 買入額(月初末)	
		4, 0 0 0	
		10/17	4,000.
		社債買入額(月初末)	
		0	
		ETF買入額(企業支援)	
		1 4, 6 2 8	
		約定 21/ 3/31	12.
		J-REIT買入額	
		6, 8 2 3	
		約定 22/ 6/14	12.
		※直近約1週間の実施分を記載	

※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17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 +0.024000	3M 買気配 -0.180
1W 売気配 -0.020	2M 0.000000	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M +0.049000	1Y 買気配 -0.060
1M 売気配 -0.020		

<10月16日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	178,461	-14,670
有担保	28,443	+836
無担保	150,018	-15,506

<10月17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	-0.015	+0.013					-0.096	+0.001
トムネ				-----					-0.107	+0.012
スポネ				-----						
1週間物	-0.030	-0.018	-0.027	-0.001					-0.147	-0.002
2週間物	-0.020	0.001	-0.014	+0.010					-0.161	± 0
3週間物				-----					-0.169	± 0
1ヶ月物	-0.023	-0.003	-0.012	+0.012					-0.181	-0.003
3ヶ月物				-----					-0.198	-0.001
6ヶ月物				-----					-0.127	± 0
1年物				-----					-0.087	-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