

東京短資デイリーレポート

2024/10/2

<10月1日のマナタリーベース>

6,706,500

<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	5,429,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,465,600
日銀当座預金残高増減前日比	-36,300

<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		-52,700
資金過不足		-52,300
金融調節		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補充供給	+14,500	-12,200
金融調節合計		+2,300
当座預金増減-②		-50,000

<10月2日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,415,600
準備預金残高	4,859,900
積み終了先	4,859,300
超過準備	4,859,300
非準備先残高	555,700

<参考>

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)	2,600
残り要積立額(平均)	200
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		-400
財政等要因		+700
資金過不足		+300
金融調節確定分		
国債買入		+8,600
国債補充供給	+12,200	
金融調節合計		+20,800
当座預金増減		+21,100

<10月3日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残543兆6,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.277% での出合いが中心か。
--

<10月3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	5,481,700	+66,100
+40,000	5,476,700	+61,100
+35,000	5,471,700	+56,100
+30,000	5,466,700	+51,100
+25,000	5,461,700	+46,100
+20,000	5,456,700	+41,100
+15,000	5,451,700	+36,100
+10,000	5,446,700	+31,100
+5,000	5,441,700	+26,100
± 0	5,436,700	+21,100
-5,000	5,431,700	+16,100
-10,000	5,426,700	+11,100
-15,000	5,421,700	+6,100
-20,000	5,416,700	+1,100
-25,000	5,411,700	-3,900
-30,000	5,406,700	-8,900
-35,000	5,401,700	-13,900
-40,000	5,396,700	-18,900
-45,000	5,391,700	-23,900

<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(-1Y)	24/10/ 3	1,500億 応札 3,031億 落札 1,503億 最低 -0.005% 平均 +0.006% 按分 28.0%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	24/10/ 3	3,250億 応札 11,297億 落札 3,256億 最低 -0.017% 平均 -0.016% 按分 96.4%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/10/ 3	3,250億 応札 11,358億 落札 3,259億 最低 -0.014% 平均 -0.014% 按分 65.8%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/10/ 3	750億 応札 1,506億 落札 752億 最低 -0.008% 平均 -0.004% 按分 17.8%
(11:50) 国債補充供給	24/10/ 2-24/10/ 3	応札 12,445億 落札 12,445億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補充供給	24/10/ 2-24/10/ 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
9 9, 2 2 7	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
10/ 2~10/16 8,006.	9/26(1-3Y) 3,501.	2 9, 7 1 9	8 5 7, 8 0 2
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/26(3-5Y) 3,754.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/26(5-10Y) 4,003.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/10~ 1/10 20,011.	9/26(10-25Y) 1,500.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.
1/13~ 1/14 20,008.	9/26(物国) 601.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.
1/16~ 1/16 20,009.	(10/ 3(-1Y) 1,503.)	12/ 1~12/ 1 2,464.	※直近約1年分の期落ち分を記載
1/19~ 1/20 1,163.	(10/ 3(1-3Y) 3,256.)	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	米ドル資金供給オペ
	(10/ 3(3-5Y) 3,259.)	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	0 百万ドル
	(10/ 3(25Y-) 752.)	12/ 4~12/ 4 3,325.	9/26-10/ 3 0.
			(10/ 3-10/10 1.)
			※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 2, 4 0 1 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
			※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
			1 2, 4 4 5
			10/ 2~10/ 3 12,445.
			10/ 2~10/ 3 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
			CP買入額(月初末)
			0
			社債買入額(月初末)
			0
			<10月2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 手形売切 0
			貸出増加支援 783,814 国債売現先 0
			供給オペ合計 1,099,167 国債補充供給 12,445
			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 12,445
			差し引き 1,086,722

※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日のオプション市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP現先	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N +0.200	1M +0.260000	3M 買気配 +0.100
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1日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	110,691	+3,768
有担保	41,380	+2,788
無担保	69,311	+980

<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	0.220	0.227	0.227	± 0				-----	0.242	± 0
トムネ				-----				-----	0.230	-0.009
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.226	0.390	0.253	+0.003				-----	0.201	-0.001
2週間物	0.227	0.310	0.235	-0.035				-----	0.200	± 0
3週間物				-----				-----	0.200	± 0
1ヶ月物	0.290	0.300	0.295	+0.012				-----	0.200	± 0
3ヶ月物				-----				-----	0.208	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.252	± 0
1年物				-----				-----	0.318	± 0

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