

東京短資デイリーレポート

2024/10/3

<10月2日のマネタリーベース>

6,656,100

<10月3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	5,436,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,415,600
日銀当座預金残高増減前日比	+21,100

<10月3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	-500
財政等要因	+2,100
資金過不足	+1,600
金融調節	
国債買入	期落 新規
	+8,600
国債補完供給	+12,200 -11,300
金融調節合計	+9,500
当座預金増減-②	+11,100

<10月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,426,700
準備預金残高	4,870,400
積み終了先	4,870,000
超過準備	4,870,000
非準備先残高	556,300

<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)	2,200
残り要積立額(平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	60.0
進捗率乖離幅	+39.9

<10月4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	-26,500
資金過不足	-25,900
金融調節確定分	
国債補完供給	期落 新規
	+11,300
金融調節合計	+11,300
当座預金増減	-14,600

<10月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆2,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.277% での合いが中心か。

<10月4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	5,457,100	+30,400
+40,000	5,452,100	+25,400
+35,000	5,447,100	+20,400
+30,000	5,442,100	+15,400
+25,000	5,437,100	+10,400
+20,000	5,432,100	+5,400
+15,000	5,427,100	+400
+10,000	5,422,100	-4,600
+5,000	5,417,100	-9,600
±0	5,412,100	-14,600
-5,000	5,407,100	-19,600
-10,000	5,402,100	-24,600
-15,000	5,397,100	-29,600
-20,000	5,392,100	-34,600
-25,000	5,387,100	-39,600
-30,000	5,382,100	-44,600
-35,000	5,377,100	-49,600
-40,000	5,372,100	-54,600
-45,000	5,367,100	-59,600

<10月3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。

(11:50) 国債補完供給	24/10/ 3-24/10/ 4	応札 11,543億 落札 11,543億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/10/ 3-24/10/ 4	応札 0億 落札 0億

<10月3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)	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
9,227	8,770	29,719	857,802	899
10/ 2~10/16 8,006.	9/26(1-3Y) 3,501.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	11/18~11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/26(3-5Y) 3,754.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	2/17~ 2/17 346.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/26(5-10Y) 4,003.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.	9/26(10-25Y) 1,500.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.	9/26(物国) 601.	12/ 1~12/ 1 2,464.	10/ 3~10/10 1.	8/19~ 8/18 279.
1/16~ 1/16 20,009.	10/ 3(-1Y) 1,503.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	10/ 3~10/10 1.	8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	10/ 3(1-3Y) 3,256.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	10/ 3~10/10 1.	11/17~11/17 0.
	10/ 3(3-5Y) 3,259.	12/ 4~12/ 4 3,325.	10/ 3~10/10 1.	2/16~ 2/16 0.
	10/ 3(25Y-) 752.			
		※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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		11,543		
		10/ 3~10/ 4 11,543.		
		10/ 3~10/ 4 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		
		共通担保(全店)金利入札		
		70,035		
		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.		
		10/10~10/10 10,006.		
		10/25~10/25 10,003.		
		※直近約1週間の実施分を記載		
		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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		11,543		
		10/ 3~10/ 4 11,543.		
		10/ 3~10/ 4 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		
		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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		11,543		
		10/ 3~10/ 4 11,543.		
		10/ 3~10/ 4 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		
		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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		11,543		
		10/ 3~10/ 4 11,543.		
		10/ 3~10/ 4 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		
		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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		11,543		
		10/ 3~10/ 4 11,543.		
		10/ 3~10/ 4 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		
		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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		11,543		
		10/ 3~10/ 4 11,543.		
		10/ 3~10/ 4 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		
		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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		国債補完供給		
		11,543		
		10/ 3~10/ 4 11,543.		
		10/ 3~10/ 4 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		
		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		
		国債売現先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		