

東京短資デイリーレポート

2024/10/8

<10月7日のマネタリーベース>

6,643,300

<10月8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	5,421,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,403,200
日銀当座預金残高増減前日比	+18,200

<10月8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		-3,500
資金過不足		-3,400
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+11,700
CP等買入	-200	
国債補充供給	+11,100	-11,100
金融調節合計		+11,500
当座預金増減-②		+8,100

<10月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,411,300
準備預金残高	4,836,400
積み終了先	4,836,300
超過準備	4,836,300
非準備先残高	574,900

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,924,400
今積み期間所要準備額 (平均)	130,800
残り要積立額 (積数)	300
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	76.7
進捗率乖離幅	+23.2

<10月9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		+100
財政等要因		-9,400
資金過不足		-9,300
金融調節確定分		
	期落	新規
社債等買入	-200	
国債補充供給	+11,100	
金融調節合計		+10,900
当座預金増減		+1,600

<10月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆2,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での出合いが中心か。
--

<10月9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	5,457,900	+46,600
+40,000	5,452,900	+41,600
+35,000	5,447,900	+36,600
+30,000	5,442,900	+31,600
+25,000	5,437,900	+26,600
+20,000	5,432,900	+21,600
+15,000	5,427,900	+16,600
+10,000	5,422,900	+11,600
+5,000	5,417,900	+6,600
± 0	5,412,900	+1,600
-5,000	5,407,900	-3,400
-10,000	5,402,900	-8,400
-15,000	5,397,900	-13,400
-20,000	5,392,900	-18,400
-25,000	5,387,900	-23,400
-30,000	5,382,900	-28,400
-35,000	5,377,900	-33,400
-40,000	5,372,900	-38,400
-45,000	5,367,900	-43,400

<10月8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。

(10:40) 米ドル資金供給	24/10/10-24/10/17	応札 0m1l 落札 0m1l	貸付 5.080%
(11:50) 国債補充供給	24/10/ 8-24/10/ 9	応札 11,408億 落札 11,408億 全取 -0.050% 平均 -0.050%	
(13:50) 国債補充供給	24/10/ 8-24/10/ 9	応札 10億 落札 10億 全取 -0.050% 平均 -0.050%	

<10月8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(月初来)	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
99,227	20,539	29,719	857,802	899
10/ 2~10/16 8,006.	10/ 3(-1Y) 1,503.	12/ 2-12/ 2 1,712.	12/15-12/13 54,701.	11/18-11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	10/ 3(1-3Y) 3,256.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	2/17~ 2/17 346.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	10/ 3(3-5Y) 3,259.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.	10/ 3(25Y-) 752.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.	10/ 8(1-3Y) 3,256.	12/ 1-12/ 1 2,464.	※直近約1年分の期落ち分を記載	8/19~ 8/18 279.
1/16~ 1/16 20,009.	10/ 8(3-5Y) 3,252.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	米ドル資金供給オペ	8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	10/ 8(5-10Y) 3,758.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	10/ 3~10/10 1.	11/17-11/17 0.
	10/ 8(10-25Y) 1,503.	12/ 4-12/ 4 3,325.	(10/10-10/17 0.)	2/16~ 2/16 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		
		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		
		国庫短期証券買入額(月初来)		
		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)(月初来)		
		0		
		国債補充供給		
		11,418		
		10/ 8-10/ 9 11,408.		
		10/ 8-10/ 9 10.		
		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		
		CP買入額(月初来)		
		0		
		社債買入額(月初来)		
		0		

<10月8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)	18,800
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	手形売出	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	11,418
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	11,418
	差し引き		1,087,749

※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8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 +0.200	1M +0.252000	3M 買気配 +0.060
1W 売気配 +0.200	2M +0.278000	6M 買気配 +0.060
2W 売気配 +0.200	3M -----	1Y 買気配 +0.020
1M 売気配 +0.200		

<10月7日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	116,268	+4,252
有担保	41,178	+3,420
無担保	75,090	+832

<10月8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				-----	0.191	-0.042
トムネ				-----				-----	0.188	-0.045
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.230	0.390	0.271	+0.045				-----	0.200	-0.001
2週間物				-----				-----	0.200	± 0
3週間物				-----				-----	0.200	± 0
1ヶ月物			0.290	-----				-----	0.201	± 0
3ヶ月物				-----				-----	0.209	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.252	+0.001
1年物				-----				-----	0.317	± 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