

東京短資デイリーレポート

2024/10/18

<10月17日のマネタリーベース>

6,714,700

<10月18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	5,485,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,474,500
日銀当座預金残高増減前日比	+11,300

<10月18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		-200
財政等要因		+2,900
資金過不足		+2,700
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+8,600	-8,500
金融調節合計		-100
当座預金増減-②		+2,600

<10月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,477,100
準備預金残高	4,903,700
積み終了先	4,898,900
超過準備	4,879,700
非準備先残高	573,400

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,041,000
今積み期間所要準備額 (平均)	130,400
残り要積立額 (積数)	21,200
残り要積立額 (平均)	800
準備進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	16.1
進捗率乖離幅	+83.3

<10月21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		+15,500
資金過不足		+15,100
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+11,100
CP等買入	-200	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+8,500	
金融調節合計		+19,300
当座預金増減		+34,400

<10月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆1,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<10月21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	5,556,500	+79,400
+40,000	5,551,500	+74,400
+35,000	5,546,500	+69,400
+30,000	5,541,500	+64,400
+25,000	5,536,500	+59,400
+20,000	5,531,500	+54,400
+15,000	5,526,500	+49,400
+10,000	5,521,500	+44,400
+5,000	5,516,500	+39,400
± 0	5,511,500	+34,400
-5,000	5,506,500	+29,400
-10,000	5,501,500	+24,400
-15,000	5,496,500	+19,400
-20,000	5,491,500	+14,400
-25,000	5,486,500	+9,400
-30,000	5,481,500	+4,400
-35,000	5,476,500	-600
-40,000	5,471,500	-5,600
-45,000	5,466,500	-10,600

<10月18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-3Y)	24/10/21	3,250億	応札 7,649億	落札 3,256億	最低 +0.008%	平均 +0.009%	按分 77.2%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/10/21	3,250億	応札 10,150億	落札 3,257億	最低 +0.012%	平均 +0.014%	按分 15.3%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/10/21	3,750億	応札 8,607億	落札 3,758億	最低 +0.013%	平均 +0.016%	按分 86.9%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/10/21	750億	応札 1,607億	落札 752億	最低 +0.004%	平均 +0.010%	按分 37.8%
(10:40) 社債買入	24/10/23	500億	応札 1,208億	落札 500億	最低 +0.666%	平均 +0.693%	按分 10.0%
(11:50) 国債補完供給	24/10/18-24/10/21		応札 8,730億	落札 8,730億	全取 -0.050%	平均 -0.050%	
(13:50) 国債補完供給	24/10/18-24/10/21		応札 0億	落札 0億			

<10月18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	29,049			899					
10/16-10/30	8,006	10/15(1-3Y)	3,254	29,719	857,802	11/18-11/18	93.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014	10/15(5-10Y)	3,753	12/ 2-12/ 2	1,712	12/15-12/13	54,701	2/17~ 2/17	346.
1/ 5~ 1/ 6	10,016	10/15(10-25Y)	1,503	3/ 3~ 3/ 3	6,793	3/17~ 3/17	64,498	5/17~ 5/12	0.
1/10~ 1/10	20,011	(10/21(1-3Y)	3,256	6/ 2~ 6/ 2	2,644	6/18~ 6/18	26,498	5/12~ 5/12	181.
1/13~ 1/14	20,008	(10/21(3-5Y)	3,257	9/ 1~ 9/ 1	5,024	9/15~ 9/12	27,659	8/19~ 8/18	279.
1/16~ 1/16	20,009	(10/21(5-10Y)	3,758	12/ 1-12/ 1	2,464			8/18~ 8/18	0.
1/19~ 1/20	1,163	(10/21(25Y-)	752	3/ 2~ 3/ 2	7,922			11/17-11/17	0.
				6/ 3~ 6/ 3	3,160	※直近約1年分の期落ち分を記載		2/16~ 2/16	0.
				12/ 4-12/ 4	3,325	米ドル資金供給オペ			
						0百万ドル			
						10/17-10/24	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			
						国債補完供給			
						8,730			
						10/18-10/21	8,730		
						10/18-10/21	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)固定	99,227	CP等買入(推定)	18,000
						共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	54,400
						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	国債補完供給	8,730
						貸出(推定)	0	国債現(米ドル担保)	0
						供給額合計	1,099,167	吸収額合計	8,730
						差し引き	1,090,437		

※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18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	+0.250000	3M	買気配 +0.100
1W	売気配 +0.200	2M	+0.264000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	+0.345000	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.200				

<10月17日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	110,598	+723
有担保	38,474	-687
無担保	72,124	+1,410

<10月18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	0.221	0.227	0.227	± 0					0.232	-0.005
トムネ				-----					0.239	+0.004
スポネ				-----						
1週間物	0.230	0.269	0.262	-0.128					0.201	-0.002
2週間物			0.280	-0.015					0.201	± 0
3週間物				-----					0.201	± 0
1ヶ月物				-----					0.202	+0.001
3ヶ月物				-----					0.209	-0.001
6ヶ月物				-----					0.257	+0.001
1年物				-----					0.321	± 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