

# 東京短資デイリーレポート

2024/10/22

## <10月21日のマネタリーベース>

6,735,300
-----------

## <10月22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	5,498,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,494,500
日銀当座預金残高増減前日比	+3,700

## <10月22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		-4,100
資金過不足		-4,500
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+8,000	-8,700
金融調節合計		-700
当座預金増減-②		-5,200

## <10月22日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,489,300
準備預金残高	4,901,700
積み終了先	4,899,500
超過準備	4,899,500
非準備先残高	587,600

## <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)	15,100
残り要積立額 (平均)	600
準備進捗率 (%)	99.6
日数進捗率 (%)	22.6
進捗率乖離幅	+77.0

## <10月23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		-300
財政等要因		-7,700
資金過不足		-8,000
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入		+500
国債補完供給	+8,700	
金融調節合計		+9,000
当座預金増減		+1,000

## <10月23日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残549兆300億円)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23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	5,535,300	+46,000
+40,000	5,530,300	+41,000
+35,000	5,525,300	+36,000
+30,000	5,520,300	+31,000
+25,000	5,515,300	+26,000
+20,000	5,510,300	+21,000
+15,000	5,505,300	+16,000
+10,000	5,500,300	+11,000
+5,000	5,495,300	+6,000
± 0	5,490,300	+1,000
-5,000	5,485,300	-4,000
-10,000	5,480,300	-9,000
-15,000	5,475,300	-14,000
-20,000	5,470,300	-19,000
-25,000	5,465,300	-24,000
-30,000	5,460,300	-29,000
-35,000	5,455,300	-34,000
-40,000	5,450,300	-39,000
-45,000	5,445,300	-44,000

## <10月22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	24/10/24-24/10/31	応札 2m1l 落札 2m1l	貸付 5.080%
(11:50) 国債補完供給	24/10/22-24/10/23	応札 8,856億 落札 8,856億 全取 -0.050% 平均 -0.050%	
(13:50) 国債補完供給	24/10/22-24/10/23	応札 0億 落札 0億	
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	24/10/23-24/11/1	5,000億 応札 2億 落札 2億 全取 +0.220% 平均 +0.220%	

## <10月22日 各オペ残高と内訳>

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				
99,227		40,072		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		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.	※直近約1年分の期落ち分を記載			8/18~8/18	0.
1/19~1/20	1,163.	10/21(25Y-)	752.	3/2~3/2	7,922.	米ドル資金供給オペ		11/17~11/17	0.	
				6/3~6/3	3,160.	0百万ドル		2/16~2/16	0.	
				12/4~12/4	3,325.	10/17~10/24				
				※直近約1年分の期落ち分を記載		(10/24~10/31		2.)		
				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.					
				国債買入先オペ						
				0						
						国債売入先(米ドルオペ用担保)				
						0				
						(10/23~11/1		2.)		
						国庫短期証券買入額(月初末)				
						0				
						国債売入先オペ				
						0				
						C P買入額(月初末)				
						0				
						社債買入額(月初末)				
						0				
						(10/23		500.)		
						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22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	+0.25500	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21日のJ-ボンド市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	111,134	-3,481
有担保	38,822	-642
無担保	72,312	-2,839

## <10月22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	0.228	0.227	± 0					0.229	-0.007
トムネ									0.232	-0.004
スポネ										
1週間物	0.231	0.390	0.303	+0.076					0.204	+0.003
2週間物									0.202	+0.001
3週間物									0.202	+0.001
1ヶ月物									0.203	+0.002
3ヶ月物									0.212	+0.001
6ヶ月物									0.274	+0.008
1年物									0.327	+0.003

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。非市場債券(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