

東京短資デイリーレポート

2023/9/1

<8月31日のマネタリーベース>

6,744,200

<9月1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	5,475,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,484,900
日銀当座預金残高増減前日比	-9,600

<9月1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	+600	
財政等要因	-36,500	
資金過不足	-35,900	
金融調節		
CP等買入	期落	新規
社債等買入	-100	
国債補完供給	+28,400	-32,900
成長基盤強化支援	-3,700	
金融調節合計		-8,400
当座預金増減-②		-44,300

<9月1日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,440,600
準備預金残高	4,730,600
積み終了先	4,729,500
超過準備	4,729,400
非準備先残高	710,000

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,009,600
今積み期間所要準備額 (平均)	129,300
残り要積立額 (積数)	5,700
残り要積立額 (平均)	500
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	61.3
進捗率乖離幅	+38.5

<9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	+1,000	
財政等要因	-23,200	
資金過不足	-22,200	
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
社債等買入	-500	
国債補完供給	+32,900	
金融調節合計		+32,300
当座預金増減		+10,100

<9月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残545兆700億円)で 無担保コール0/Nは-0.075%~-0.055% での合いが中心か。

<9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	5,495,700	+55,100
+40,000	5,490,700	+50,100
+35,000	5,485,700	+45,100
+30,000	5,480,700	+40,100
+25,000	5,475,700	+35,100
+20,000	5,470,700	+30,100
+15,000	5,465,700	+25,100
+10,000	5,460,700	+20,100
+5,000	5,455,700	+15,100
±0	5,450,700	+10,100
-5,000	5,445,700	+5,100
-10,000	5,440,700	+100
-15,000	5,435,700	-4,900
-20,000	5,430,700	-9,900
-25,000	5,425,700	-14,900
-30,000	5,420,700	-19,900
-35,000	5,415,700	-24,900
-40,000	5,410,700	-29,900
-45,000	5,405,700	-34,900

<9月1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(固)(5Y-10Y)	23/ 9/ 4	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.355%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/ 4	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.600%
(11:50) 国債補完供給	23/ 9/ 1-23/ 9/ 4	応札	32,431億	落札	32,431億	全取	-0.450% 平均 -0.451%
(13:50) 国債補完供給	23/ 9/ 1-23/ 9/ 4	応札	851億	落札	851億	全取	-0.450% 平均 -0.450%
(14:00) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/ 4	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.570%

<9月1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	
100,052	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
8/30~ 9/13 8,831.	8/31(3-5Y) 4,505.	45,943	754,212	11/19-11/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	8/31(5-10Y) 6,758.	9/ 4~ 9/ 4 34.	9/17~ 9/15 13,014.	2/18~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	8/31(10-25Y) 2,004.	12/ 4~12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.	5/17~ 5/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	8/31(25Y-) 1,003.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	8/19~ 8/19 381.
1/13~ 1/14 20,008.	8/31(物国) 600.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18-11/18 93.
1/16~ 1/16 20,009.		9/ 2~ 9/ 2 1,804.		2/17~ 2/17 346.
1/19~ 1/20 1,163.		12/ 2~12/ 2 1,712.		5/12~ 5/12 181.
		3/ 3~ 3/ 3 6,793.		8/18~ 8/18 0.
		6/ 2~ 6/ 2 2,644.		
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			8/31~ 9/ 7 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	
			17,427百万ドル	
			9/ 2~ 9/ 5 6,101.	
			12/ 2~12/ 4 3,607.	
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.	
			(9/ 5~ 9/ 5 5,382.)	
			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	
			33,282	
			9/ 1~ 9/ 4 32,431.	
			9/ 1~ 9/ 4 851.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			C P買入額(月初末)	
			0	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			貸出増加支援	
			683,578	
			手形売出	
			0	
			国債売現先	
			0	
			供給オペ合計	
			928,783	
			国債補完供給	
			33,282	
			貸出(推定)	
			0	
			国債売現先(米ドル担保)	
			0	
			供給額合計	
			928,783	
			吸収額合計	
			33,282	
			差し引き	
			895,501	

※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。

<9月1日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	NCD/CP買現先	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N	0.000	1M 0.000000	3M 買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.090
1M	売気配 -0.020		

<8月31日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	189,724	-18,571
有担保	27,329	+2,563
無担保	162,395	-21,134

<9月1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	-0.087	-0.001	-0.060	-0.004					-0.148	+0.013
トムネ									-0.152	+0.012
スポネ										
1週間物			-0.033	+0.007					-0.155	+0.007
2週間物	-0.070	0.030	-0.035	+0.010					-0.157	+0.001
3週間物			0.001	+0.036					-0.158	±0
1ヶ月物									-0.165	-0.003
3ヶ月物									-0.143	-0.001
6ヶ月物									-0.123	±0
1年物									-0.092	±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