

東京短資デイリーレポート

2023/9/15

<9月14日のマネタリーベース>

6,668,200

<9月15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	5,462,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,413,000
日銀当座預金残高増減前日比	+49,200

<9月15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		+300
財政等要因		-4,500
資金過不足		-4,200
金融調節		
共通担保(全店)	期落	新規
CP等買入	-700	
社債等買入	-900	
国債補充供給	+26,500	-27,000
貸出増加支援	-16,800	+35,400
金融調節合計		+26,500
当座預金増減-②		+22,300

<9月15日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,435,300
準備預金残高	4,748,100
積み終了先	4,748,100
超過準備	4,748,100
非準備先残高	687,200

<参考>

翌積み期間所要準備額(積数)	3,882,600
翌積み期間所要準備額(平均)	129,400
残り要積立額(積数)	63,800
残り要積立額(平均)	2,400
準備進捗率(%)	98.3
日数進捗率(%)	10.0
進捗率乖離幅	+88.3

<9月19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		+11,900
資金過不足		+12,500
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
社債等買入	-300	
国債補充供給	-1,200	
貸出増加支援	+27,000	
金融調節合計		+25,500
当座預金増減		+38,000

<9月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当残547兆3,300億円)で 無担保コール0/Nは-0.060%~-0.0040% での合いが中心か。

<9月19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	5,518,300	+83,000
+40,000	5,513,300	+78,000
+35,000	5,508,300	+73,000
+30,000	5,503,300	+68,000
+25,000	5,498,300	+63,000
+20,000	5,493,300	+58,000
+15,000	5,488,300	+53,000
+10,000	5,483,300	+48,000
+5,000	5,478,300	+43,000
±0	5,473,300	+38,000
-5,000	5,468,300	+33,000
-10,000	5,463,300	+28,000
-15,000	5,458,300	+23,000
-20,000	5,453,300	+18,000
-25,000	5,448,300	+13,000
-30,000	5,443,300	+8,000
-35,000	5,438,300	+3,000
-40,000	5,433,300	-2,000
-45,000	5,428,300	-7,000

<9月15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(国)(5Y-10Y)	23/ 9/19	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.295%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 9/19	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.540%
(10:40) 社債買入	23/ 9/21	1,000億	応札	2,562億	落札	1,000億	最低 +0.326% 平均 +0.339% 按分 2.8%
(11:50) 国債補充供給	23/ 9/15-23/ 9/19	応札	27,423億	落札	27,423億	全取	-0.350% 平均 -0.352%
(13:50) 国債補充供給	23/ 9/15-23/ 9/19	応札	0億	落札	0億		
(14:00) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 9/19	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.510%

<9月15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)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給					
1 0 0, 5 8 3	4 2, 7 9 9	成長基盤強化支援資金供給	1 0 0 1						
9/13~ 9/27	9,362.	9/11(1-3Y)	4 5, 9 0 9	7 7 6, 6 4 6	11/19-11/17	0.			
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	9/11(3-5Y)	4,504.	12/16-12/15	20,601.	2/18~ 2/16	0.		
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	9/11(5-10Y)	6,760.	3/18~ 3/18	41,458.	5/17~ 5/17	0.		
1/10~ 1/10	20,011.	9/11(10-25Y)	2,006.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	6/19~ 6/19	63,179.	8/19~ 8/19	381.
1/13~ 1/14	20,008.	9/14(-1Y)	1,504.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.	11/18-11/18	93.
1/16~ 1/16	20,009.	9/14(1-3Y)	4,251.	12/ 2-12/ 2	1,712.			2/17~ 2/17	346.
1/19~ 1/20	1,163.	9/14(5-10Y)	6,763.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.			5/12~ 5/12	181.
		9/14(25Y)	1,001.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.			8/18~ 8/18	0.
				9/ 1~ 9/ 1	5,024.				
共通担保(全店)金利入札		5 0, 0 2 6							
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.								
国債買入現先オペ		0							
国債売先オペ(米ドルオペ用担保)									
9/13~ 9/22			6						
国債短期証券買入額(月初末)									
9/6			1,001.						
9/13			1,001.						
国債売先オペ		0							
9/6			1,001.						
9/13			1,001.						
C P買入額(月初末)									
9/13			4,000.						
社債買入額(月初末)									
(9/21			1,000.)						
J-REIT買入額									
6, 8 2 3									
約定 22/ 6/14			12.						
ETF買入額									
3 5 6, 2 2 0									
約定 23/ 3/14			701.						
ETF買入額(企業支援)									
1 4, 6 2 8									
約定 21/ 3/31			12.						
J-REIT買入額									
6, 8 2 3									
約定 22/ 6/14			12.						

※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15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	0.000	1M	-----	3M	買気配 -0.140
1W	売気配 -0.020	2M	0.000000	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020	3M	+0.055000	1Y	買気配 -0.020
1M	売気配 -0.020				

<9月14日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	165,728	-5,917
有担保	28,691	-1,095
無担保	137,037	-4,822

<9月15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	-0.043	-0.031				-----	-0.114	-0.023
トムネ			-0.040	-0.020				-----	-0.121	-0.016
スポネ								-----		
1週間物	-0.065	0.001	-0.041	+0.006				-----	-0.127	-0.009
2週間物	-0.062	0.000	-0.054	-0.032				-----	-0.153	-0.027
3週間物								-----	-0.153	-0.001
1ヶ月物								-----	-0.152	-0.002
3ヶ月物								-----	-0.135	±0
6ヶ月物								-----	-0.120	+0.004
1年物								-----	-0.084	+0.001

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、ETF・J-REIT買入は、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