

東京短資デイリーレポート

2023/9/20

<9月19日のマナリーベース>

6,693,800

<9月20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	5,513,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,439,400
日銀当座預金残高増減前日比	+74,500

<9月20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	+40,000	
資金過不足	+40,400	
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-500	
国債補充供給	+32,000	-39,300
金融調節合計	-7,900	
当座預金増減-②		+32,500

<9月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,471,900
準備預金残高	4,775,000
積み終了先	4,767,400
超過準備	4,766,300
非準備先残高	696,900

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,882,600
今積み期間所要準備額 (平均)	129,400
残り要積立額 (積数)	43,100
残り要積立額 (平均)	1,700
準備進捗率(%)	98.8
日数進捗率(%)	16.7
進捗率乖離幅	+82.1

<9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	-2,800	
資金過不足	-3,200	
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+17,600
国庫短期証券買入		+1,000
CP等買入	-200	
社債等買入	-100	+1,000
国債補充供給	+39,300	
金融調節合計		+58,600
当座預金増減		+55,400

<9月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残552兆7,300億円)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	5,572,300	+100,400
+40,000	5,567,300	+95,400
+35,000	5,562,300	+90,400
+30,000	5,557,300	+85,400
+25,000	5,552,300	+80,400
+20,000	5,547,300	+75,400
+15,000	5,542,300	+70,400
+10,000	5,537,300	+65,400
+5,000	5,532,300	+60,400
±0	5,527,300	+55,400
-5,000	5,522,300	+50,400
-10,000	5,517,300	+45,400
-15,000	5,512,300	+40,400
-20,000	5,507,300	+35,400
-25,000	5,502,300	+30,400
-30,000	5,497,300	+25,400
-35,000	5,492,300	+20,400
-40,000	5,487,300	+15,400
-45,000	5,482,300	+10,400

<9月20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)	23/ 9/21	4,250億 応札 6,709億 落札 4,251億 最低 -0.013% 平均 -0.008% 按分 84.1%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 9/21	4,500億 応札 12,404億 落札 4,506億 最低 +0.001% 平均 +0.004% 按分 58.2%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 9/21	6,750億 応札 16,221億 落札 6,756億 最低 0.000% 平均 +0.003% 按分 0.3%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 9/21	2,000億 応札 5,481億 落札 2,005億 最低 +0.006% 平均 +0.009% 按分 21.0%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/21	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.285%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/21	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.530%
(10:10) 国庫短期証券買入	23/ 9/21	1,000億 応札 6,139億 落札 1,001億 最低 0.000% 平均 +0.006% 按分 74.0%
(11:50) 国債補充供給	23/ 9/20-23/ 9/21	応札 39,469億 落札 39,469億 全取 -0.450% 平均 -0.452%
(13:50) 国債補充供給	23/ 9/20-23/ 9/21	応札 320億 落札 320億 全取 -0.450% 平均 -0.450%
(14:00) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/21	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.500%

<9月20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
100,583	42,799	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1,001
9/13~ 9/27 9,362.	9/14(-1Y) 1,504.	45,909	776,646	11/19-11/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/14(1-3Y) 4,251.	12/ 4-12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.	2/18~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/14(5-10Y) 6,763.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	9/14(25Y-) 1,001.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/13~ 1/14 20,008.	(9/21(1-3Y) 4,251.)	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18-11/18 93.
1/16~ 1/16 20,009.	(9/21(3-5Y) 4,506.)	12/ 2-12/ 2 1,712.	※直近約1年分の期落ち分を記載	2/17~ 2/17 346.
1/19~ 1/20 1,163.	(9/21(5-10Y) 6,756.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	※直近約1年分の期落ち分を記載	5/12~ 5/12 181.
	(9/21(10-25Y) 2,005.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	米ドル資金供給オペ	8/18~ 8/18 0.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	7百万ドル	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	9/14~ 9/21 7.	
		成長基盤強化支援米ドル特別	(9/21~ 9/28 0.)	
		16,708百万ドル		
		12/ 2-12/ 4 3,607.		
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.		
		6/ 2~ 6/ 3 5,566.		
		9/ 5~ 9/ 5 5,382.		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売入先(米ドルオペ用担保)		
		6		
		9/13~ 9/22 6.		
		国庫短期証券買入額(月初末)		
		0		
		国債売入先オペ		
		2,002		
		9/ 6 1,001.		
		9/13 1,001.		
		(9/21 1,001.)		
		気候変動対応支援資金供給		
		62,659		
		1/30~ 1/30 28,261.		
		7/21~ 7/19 34,398.		
		CP買入額(月初末)		
		4,000		
		9/13 4,000.		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		(9/21 1,000.)		
		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		

※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20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	+0.008000	3M	買気配 -0.140
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020	3M	0.000000	1Y	買気配 -0.130
1M	売気配 -0.020				

<9月19日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	202,699	+25,229
有担保	29,264	-575
無担保	173,435	+25,804

<9月20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	-0.056	+0.003					-0.128	+0.002
トムネ				-----					-0.174	-0.023
スポネ				-----						
1週間物	-0.059	-0.020	-0.052	-----					-0.179	-0.016
2週間物				-----					-0.198	-0.022
3週間物				-----					-0.178	-0.010
1ヶ月物				-----					-0.170	-0.005
3ヶ月物				-----					-0.140	-0.001
6ヶ月物				-----					-0.126	-0.001
1年物				-----					-0.081	+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