

東京短資デイリーレポート

2023/9/21

<9月20日のマネタリーベース>

6,725,900

<9月21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	5,527,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,471,900
日銀当座預金残高増減前日比	+55,400

<9月21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	-2,500
資金過不足	-2,900
金融調節	
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
国債補完供給	+39,300
金融調節合計	+22,000
当座預金増減-②	+19,100

<9月21日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,491,000
準備預金残高	4,783,900
積み終了先	4,780,000
超過準備	4,778,100
非準備先残高	707,100

<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)	37,400
残り要積立額 (平均)	1,600
準備進捗率(%)	99.0
日数進捗率(%)	20.0
進捗率乖離幅	+79.0

<9月22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	0
財政等要因	-5,900
資金過不足	-5,900
金融調節確定分	
CP等買入	-700
国債補完供給	+36,600
金融調節合計	+35,900
当座預金増減	+30,000

<9月22日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残552兆1,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.040%~-0.0030% での合いが中心か。
--

<9月22日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,566,000	+75,000
+40,000	5,561,000	+70,000
+35,000	5,556,000	+65,000
+30,000	5,551,000	+60,000
+25,000	5,546,000	+55,000
+20,000	5,541,000	+50,000
+15,000	5,536,000	+45,000
+10,000	5,531,000	+40,000
+5,000	5,526,000	+35,000
± 0	5,521,000	+30,000
-5,000	5,516,000	+25,000
-10,000	5,511,000	+20,000
-15,000	5,506,000	+15,000
-20,000	5,501,000	+10,000
-25,000	5,496,000	+5,000
-30,000	5,491,000	± 0
-35,000	5,486,000	-5,000
-40,000	5,481,000	-10,000
-45,000	5,476,000	-15,000

<9月21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/ 9/22	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.280%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 9/22	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.505%
(11:50) 国債補完供給	23/ 9/21-23/ 9/22	応札	37,188億	落札	37,188億	全取	-0.450% 平均 -0.451%
(13:50) 国債補完供給	23/ 9/21-23/ 9/22	応札	0億	落札	0億		

<9月21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	
100,583	60,317	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
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.		2/17~ 2/17 346.
1/19~ 1/20 1,163.	9/21(5-10Y) 6,756.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
	9/21(10-25Y) 2,005.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			9/21~ 9/28 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	
			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.	
			国債買現先オペ	
			0	国債売現先(米ドルオペ用担保)
				9/13~ 9/22 6.
				国庫短期証券買入額(月初末)
			国債売現先オペ	3,003
			0	9/ 6 1,001.
				9/13 1,001.
				9/21 1,001.
			CP買入額(月初末)	
			4,000	
			9/13 4,000.	
			社債買入額(月初末)	
			1,000	
			9/21 1,000.	
			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	
			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)	
			4,000	
			9/13 4,000.	
			社債買入額(月初末)	
			1,000	
			9/21 1,000.	
			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	
			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21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 +0.020000	3M 買気配 -0.140
1W 売気配 -0.020	2M +0.035000	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M +0.045000	1Y 買気配 -0.020
1M 売気配 -0.020		

<9月20日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	201,647	-1,052
有担保	27,915	-1,349
無担保	173,732	+297

<9月21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	-0.049	+0.007					-0.162	-0.034
トムネ									-0.181	-0.007
スポネ										
1週間物	-0.045	-0.010	-0.024	+0.028					-0.188	-0.009
2週間物									-0.209	-0.011
3週間物									-0.180	-0.002
1ヶ月物									-0.173	-0.003
3ヶ月物	0.028	0.029	0.028						-0.143	-0.003
6ヶ月物									-0.127	-0.001
1年物									-0.081	± 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、ETF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