

東京短資デイリーレポート

2023/9/25

<9月22日のマネタリーベース>

6,736,000

<9月25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	5,531,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,481,600
日銀当座預金残高増減前日比	+49,900

<9月25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	+11,400
資金過不足	+12,000
金融調節	
CP等買入	-200
社債等買入	-200
国債補完供給	+37,400
金融調節合計	+500
当座預金増減-②	+12,500

<9月25日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,494,100
準備預金残高	4,807,400
積み終了先	4,805,200
超過準備	4,805,100
非準備先残高	686,700

<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)	26,000
残り要積立額 (平均)	1,300
準備進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	33.3
進捗率乖離幅	+66.0

<9月26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	-100
財政等要因	+4,200
資金過不足	+4,100
金融調節確定分	
CP等買入	-400
国債補完供給	+36,500
金融調節合計	+36,100
当座預金増減	+40,200

<9月26日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残553兆4,300億円)で 無担保コール0/Nは-0.050%~-0.030% での合いが中心か。

<9月26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	5,579,300	+85,200
+40,000	5,574,300	+80,200
+35,000	5,569,300	+75,200
+30,000	5,564,300	+70,200
+25,000	5,559,300	+65,200
+20,000	5,554,300	+60,200
+15,000	5,549,300	+55,200
+10,000	5,544,300	+50,200
+5,000	5,539,300	+45,200
±0	5,534,300	+40,200
-5,000	5,529,300	+35,200
-10,000	5,524,300	+30,200
-15,000	5,519,300	+25,200
-20,000	5,514,300	+20,200
-25,000	5,509,300	+15,200
-30,000	5,504,300	+10,200
-35,000	5,499,300	+5,200
-40,000	5,494,300	+200
-45,000	5,489,300	-4,800

<9月25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/ 9/26	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.259%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 9/26	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.480%
(11:50) 国債補完供給	23/ 9/25-23/ 9/26	応札	37,154億	落札	37,154億	全取	-0.550% 平均 -0.551%
(13:50) 国債補完供給	23/ 9/25-23/ 9/26	応札	0億	落札	0億		

<9月25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)	成長基盤強化支援資金供給	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	60,317	45,909	776,646	1,001
9/13~ 9/27 9,362.	9/21(1-3Y) 4,251.	12/ 4-12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.	11/19-11/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/21(3-5Y) 4,506.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/21(5-10Y) 6,756.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	5/17~ 5/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	9/21(10-25Y) 2,005.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	8/19~ 8/19 381.
1/13~ 1/14 20,008.		12/ 2-12/ 2 1,712.		11/18-11/18 93.
1/16~ 1/16 20,009.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.		2/17~ 2/17 346.
1/19~ 1/20 1,163.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.		5/12~ 5/12 181.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		8/18~ 8/18 0.
			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)	
			0	
			国債短期証券買入額(月初末)	
			国債売現先オペ	
			3,003	
			9/ 6 1,001.	
			9/13 1,001.	
			9/21 1,001.	
			※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	
			37,154	
			9/25~ 9/26 37,154.	
			9/25~ 9/26 0.	
			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.	
			貸出増加支援	
			702,255	
			手形売出	
			0	
			供給オペ合計	
			956,160	
			国債補完供給	
			37,154	
			貸出(推定)	
			0	
			国債売現先(米ドル担保)	
			0	
			供給額合計	
			956,160	
			吸収額合計	
			37,154	
			差し引き	
			919,006	

※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25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 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M +0.035000	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M +0.020000	1Y 買気配 -0.130
1M 売気配 -0.020		

<9月22日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	214,493	+4,556
有担保	25,941	-1,690
無担保	188,552	+6,246

<9月25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	-0.042	-0.003					-0.130	+0.078
トムネ									-0.181	+0.108
スポネ										
1週間物	0.002	0.070	0.032	+0.055					-0.275	+0.048
2週間物	-0.040	0.020	-0.036						-0.234	+0.040
3週間物									-0.215	+0.027
1ヶ月物			0.100						-0.199	+0.014
3ヶ月物									-0.149	+0.004
6ヶ月物									-0.121	+0.006
1年物									-0.082	-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、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