東京短資デイリーレポート　2023/9/27

＜9月26日のマネタリーベース＞

6,760,400

＜9月27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	5,516,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,506,500
日銀当座預金残高増減前日比	+9,800

＜9月27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		+100
財政等要因		-19,700
資金過不足		-19,600
金融調節		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-9,400	+8,500
CP等買入	-300	
国債補完供給	+27,400	-28,100
金融調節合計		-900
当座預金増減-②		-20,500

＜9月27日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高（①+②）	5,486,000
準備預金残高	4,792,500
積み終了先	4,790,900
超過準備	4,790,900
非準預先残高	693,500

＜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）	22,300
残り要積立額（平均）	1,200
準預進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	40.0
進捗率乖離幅	+59.4

＜9月28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		+1,300
資金過不足		+900
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+14,900
CP等買入	-1,300	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+28,100	
金融調節合計		+41,600
当座預金増減		+42,500

＜9月28日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残552兆8,500億円)で
無担保コールO/Nは-0.065%～-0.055%
での出合いが中心か。

＜9月28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	5,573,500	+87,500
+40,000	5,568,500	+82,500
+35,000	5,563,500	+77,500
+30,000	5,558,500	+72,500
+25,000	5,553,500	+67,500
+20,000	5,548,500	+62,500
+15,000	5,543,500	+57,500
+10,000	5,538,500	+52,500
+5,000	5,533,500	+47,500
± 0	5,528,500	+42,500
-5,000	5,523,500	+37,500
-10,000	5,518,500	+32,500
-15,000	5,513,500	+27,500
-20,000	5,508,500	+22,500
-25,000	5,503,500	+17,500
-30,000	5,498,500	+12,500
-35,000	5,493,500	+7,500
-40,000	5,488,500	+2,500
-45,000	5,483,500	-2,500

＜9月27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(3Y-5Y)	23/ 9/28	4,500億	応札	10,544億	落札	4,508億	最低	-0.009%	平均	-0.007%	按分 22.6%
(10:10)	国債買入(5Y-10Y)	23/ 9/28	6,750億	応札	11,265億	落札	6,756億	最低	-0.017%	平均	-0.013%	按分 25.4%
(10:10)	国債買入(10Y-25Y)	23/ 9/28	2,000億	応札	6,474億	落札	2,010億	最低	-0.011%	平均	-0.008%	按分 37.2%
(10:10)	国債買入(25Y-)	23/ 9/28	1,000億	応札	2,017億	落札	1,001億	最低	-0.009%	平均	-0.006%	按分 13.8%
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/28		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.260%			
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 9/28		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.475%			
(10:10)	国債買入(物国)	23/ 9/28	600億	応札	1,536億	落札	601億	按分	-0.020円	平均	-0.063円	按分 73.9%
(11:50)	国債補完供給	23/ 9/27-23/ 9/28		応札	28,557億	落札	28,557億	全取	-0.550%	平均	-0.555%	
(13:50)	国債補完供給	23/ 9/27-23/ 9/28		応札	0億	落札	0億					

＜9月27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
99,731

9/27~10/11	8,510.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.
1/10~ 1/10	20,011.
1/13~ 1/14	20,008.
1/16~ 1/16	20,009.
1/19~ 1/20	1,163.

共通担保(全店)金利入札
50,026

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.

国債補完供給
28,557

9/27~ 9/28	28,557.
9/27~ 9/28	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.

国債買入額(月初来)
60,317

9/21(1-3Y)	4,251.
9/21(3-5Y)	4,506.
9/21(5-10Y)	6,756.
9/21(10-25Y)	2,005.
(9/28(3-5Y)	4,508.)
(9/28(5-10Y)	6,756.)
(9/28(10-25Y)	2,010.)
(9/28(25Y-)	1,001.)
(9/28(物国)	601.)

※直近約1週間の実施分を記載

国債買入額(固定利回)(月初来)
0

※直近約1週間の実施分を記載

貸出支援基金の運営として行うオペレーション

成長基盤強化支援資金供給
45,909

12/ 4~12/ 4	10,258.
3/ 4~ 3/ 4	2,178.
6/ 3~ 6/ 3	1,950.
9/ 2~ 9/ 2	1,804.
12/ 2~12/ 2	1,712.
3/ 3~ 3/ 3	6,793.
6/ 2~ 6/ 2	2,644.
9/ 1~ 9/ 1	5,024.

※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則
16,708百万ﾄﾞﾙ

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

国債売現先オペ
0

ＣＰ買入額(月初来)
4,000

9/13	4,000.
(9/29	3,994.)

社債買入額(月初来)
1,000

9/21	1,000.

貸出増加支援資金供給
776,646

12/16~12/15	20,601.
3/18~ 3/18	41,458.
6/19~ 6/19	63,179.
9/16~ 9/13	132,310.

※直近約1年分の期落ち分を記載

米ドル資金供給オペ
0百万ﾄﾞﾙ

9/21~ 9/28	0.
(9/28~10/ 5	0.)

国債売現先(米ドルオペ用担保)
0

国庫短期証券買入額(月初来)
4,003

9/ 6	1,001.
9/13	1,001.
9/21	1,001.
9/27	1,000.

被災地金融機関支援資金供給
1,001

11/19~11/17	0.
2/18~ 2/16	0.
5/17~ 5/17	0.
8/19~ 8/19	381.
11/18~11/18	93.
2/17~ 2/17	346.
5/12~ 5/12	181.
8/18~ 8/18	0.

新型コロナ企業金融支援
0

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.

＜9月27日 日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	99,731	CP等買入(推定)	26,300
共通担保(全)金入	50,026	社債等買入(推定)	67,500
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	1,001		
気候変動対応支援	62,648		
成長基盤支援	39,647		
貸出増加支援	702,255	手形売出	0
新型コロナ企業金融支援	0	国債売現先	0
供給オペ合計	955,308	国債補完供給	28,557
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	955,308	吸収額合計	28,557
差し引き	926,751		

※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27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 -0.180
1W	売気配 -0.020	2M	+0.039000	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020	3M	+0.010000	1Y	買気配 -0.070
1M	売気配 -0.020				

＜9月26日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)＞

	残高	増減
市場合計	226,934	+18,685
有担保	21,860	-5,985
無担保	205,074	+24,670

＜9月27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	-0.064	-0.013				------	-0.259	-0.074
トムネ				------				------	-0.397	-0.146
スポネ			0.001	------				------		
1週間物	0.001	0.005	0.003	-0.039				------	-0.409	-0.083
2週間物				------				------	-0.278	-0.026
3週間物				------				------	-0.236	-0.012
1ヶ月物			0.180	------				------	-0.207	-0.004
3ヶ月物			0.008	------				------	-0.155	-0.003
6ヶ月物				------				------	-0.120	± 0
1年物				------				------	-0.083	-0.002

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