# 東京短資デイリーレポート　2023/9/28

## ＜9月27日のマネタリーベース＞

| |
|---|
| 6,739,900 |

## ＜9月28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 | 5,528,500 |
| 前日の日銀当座預金残高-① | 5,486,000 |
| 日銀当座預金残高増減前日比 | +42,500 |

## ＜9月28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 |
| 財政要因 | | 0 |
| 資金過不足 | | -400 |
| 金融調節 | | |
| | 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 | -33,500 |
| 金融調節合計 | | +8,100 |
| 当座預金増減-② | | +7,700 |

## ＜9月28日の日銀当座預金状況＞

| | |
|---|---|
| 当座預金残高（①+②） | 5,493,700 |
| 準備預金残高 | 4,796,200 |
| 積み終了先 | 4,794,800 |
| 超過準備 | 4,794,300 |
| 非準預先残高 | 697,500 |

## ＜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） | 20,400 |
| 残り要積立額（平均） | 1,200 |
| 準預進捗率(%) | 99.4 |
| 日数進捗率(%) | 43.3 |
| 進捗率乖離幅 | +56.1 |

## ＜9月29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 | | -3,600 |
| 資金過不足 | | -3,500 |
| 金融調節確定分 | | |
| | 期落 | 新規 |
| CP等買入 | -6,500 | +4,000 |
| 国債補完供給 | +33,500 | |
| 金融調節合計 | | +31,000 |
| 当座預金増減 | | +27,500 |

## ＜9月29日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残552兆1,200億円)で
無担保コールO/Nは-0.075%～-0.060%
での出合いが中心か。

## ＜9月29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 | 5,566,200 | +72,500 |
| +40,000 | 5,561,200 | +67,500 |
| +35,000 | 5,556,200 | +62,500 |
| +30,000 | 5,551,200 | +57,500 |
| +25,000 | 5,546,200 | +52,500 |
| +20,000 | 5,541,200 | +47,500 |
| +15,000 | 5,536,200 | +42,500 |
| +10,000 | 5,531,200 | +37,500 |
| +5,000 | 5,526,200 | +32,500 |
| ± 0 | 5,521,200 | +27,500 |
| -5,000 | 5,516,200 | +22,500 |
| -10,000 | 5,511,200 | +17,500 |
| -15,000 | 5,506,200 | +12,500 |
| -20,000 | 5,501,200 | +7,500 |
| -25,000 | 5,496,200 | +2,500 |
| -30,000 | 5,491,200 | -2,500 |
| -35,000 | 5,486,200 | -7,500 |
| -40,000 | 5,481,200 | -12,500 |
| -45,000 | 5,476,200 | -17,500 |

## ＜9月28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(固)(5Y-10Y) | 23/ 9/29 | 応札 | 0億 | 落札 | 0億 | 固定利回較差 | +0.265% |
| (10:10) | 国債買入(固)(5Y-10Y) | 23/ 9/29 | 応札 | 0億 | 落札 | 0億 | 固定利回較差 | +0.475% |
| (11:50) | 国債補完供給 | 23/ 9/28-23/ 9/29 | 応札 | 34,050億 | 落札 | 34,050億 | 全取 -0.650% | 平均 -0.651% |
| (13:50) | 国債補完供給 | 23/ 9/28-23/ 9/29 | 応札 | 0億 | 落札 | 0億 | | |

## ＜9月28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**
34,050

| | |
|---|---|
| 9/28~ 9/29 | 34,050. |
| 9/28~ 9/29 | 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)**
75,193

| | |
|---|---|
| 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

| | |
|---|---|
| 9/28~10/ 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28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) | 25,000 |
| 共通担保(全)金入 | 50,026 | 社債等買入(推定) | 67,400 |
| 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 | 34,050 |
| 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 | 34,050 |
| 差し引き | 921,258 | | |

※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28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 | +0.005000 | 3M | 買気配 -0.180 |
| 1W | 売気配 -0.020 | 2M | +0.045000 | 6M | 買気配 -0.130 |
| 2W | 売気配 -0.020 | 3M | ------ | 1Y | 買気配 -0.100 |
| 1M | 売気配 -0.020 | | | | |

## ＜9月27日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)

| | 残高 | 増減 |
|---|---|---|
| 市場合計 | 226,543 | -391 |
| 有担保 | 22,837 | +977 |
| 無担保 | 203,706 | -1,368 |

## ＜9月28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 | -0.063 | +0.001 | | | | ------ | -0.259 | ± 0 |
| トムネ | | | -0.060 | ------ | | | | ------ | -0.547 | -0.150 |
| スポネ | | | | ------ | | | | ------ | | |
| 1週間物 | | | -0.060 | -0.063 | | | | ------ | -0.362 | +0.047 |
| 2週間物 | -0.057 | 0.001 | -0.042 | ------ | | | | ------ | -0.263 | +0.015 |
| 3週間物 | | | | ------ | | | | ------ | -0.221 | +0.015 |
| 1ヶ月物 | -0.022 | 0.040 | -0.014 | -0.194 | | | | ------ | -0.197 | +0.010 |
| 3ヶ月物 | | | 0.030 | +0.022 | | | | ------ | -0.155 | ± 0 |
| 6ヶ月物 | | | | ------ | | | | ------ | -0.120 | ± 0 |
| 1年物 | | | | ------ | | | | ------ | -0.083 | ± 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、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