

東京短資デイリーレポート

2023/10/20

<10月19日のマネタリーベース>

6,729,100

<10月20日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーマル
日銀発表の日銀当座預金残高	5,503,700
前日の日銀当座預金残高 ^{-①}	5,475,100
日銀当座預金残高増減前日比	+28,600

<10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	-100
財政等要因	-6,700
資金過不足	-6,800
金融調節	
CP等買入	-200
社債等買入	-1,600
国債補完供給	+37,800
金融調節合計	+1,900
当座預金増減 ^{-②}	-4,900

<10月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 ^(①+②)	5,470,200
準備預金残高	4,791,200
積み終了先	4,786,900
超過準備	4,785,800
非準備先残高	679,000

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,006,500
今積み期間所要準備額(平均)	129,200
残り要積立額(積数)	25,600
残り要積立額(平均)	1,100
準備進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	22.6
進捗率乖離幅	+76.7

<10月23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	+8,700
資金過不足	+8,800
金融調節確定分	
CP等買入	-300
国債補完供給	+34,100
金融調節合計	+33,800
当座預金増減	+42,600

<10月23日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーマル (当預残551兆2,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での出合いが中心か。
--

<10月23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	5,557,800	+87,600
+40,000	5,552,800	+82,600
+35,000	5,547,800	+77,600
+30,000	5,542,800	+72,600
+25,000	5,537,800	+67,600
+20,000	5,532,800	+62,600
+15,000	5,527,800	+57,600
+10,000	5,522,800	+52,600
+5,000	5,517,800	+47,600
±0	5,512,800	+42,600
-5,000	5,507,800	+37,600
-10,000	5,502,800	+32,600
-15,000	5,497,800	+27,600
-20,000	5,492,800	+22,600
-25,000	5,487,800	+17,600
-30,000	5,482,800	+12,600
-35,000	5,477,800	+7,600
-40,000	5,472,800	+2,600
-45,000	5,467,800	-2,400

<10月20日 日銀オペ入札結果>

(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/23	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.160%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/23	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.395%
(11:50) 国債補完供給	23/10/20-23/10/23	応札 34,765億 落札 34,765億	全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/10/20-23/10/23	応札 50億 落札 50億	全取 -0.350% 平均 -0.350%

<10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
97,581	56,586	成長基盤強化支援資金供給	1,001
10/11-10/25 6,360.	10/17(1-3Y) 4,253.	貸出増加支援資金供給	11/19-11/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	10/17(3-5Y) 4,505.	12/ 4-12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	10/17(5-10Y) 6,756.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/10~ 1/10 20,011.	10/17(25Y-) 1,006.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/13~ 1/14 20,008.	10/19(5-10Y) 3,010.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/16~ 1/16 20,009.	10/19(10-25Y) 1,005.	12/ 2-12/ 2 1,712.	11/18-11/18 93.
1/19~ 1/20 1,163.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	2/17~ 2/17 346.
		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	5/12~ 5/12 181.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	8/18~ 8/18 0.
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			米ドル資金供給オペ
			3百万ドル
			10/19-10/26 3.
			※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
			国庫短期証券買入額(月初末)
			0
			国債売現先オペ
			3,002
			10/ 4 1,001.
			10/12 1,000.
			10/18 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
			34,815
			10/20-10/23 34,765.
			10/20-10/23 50.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			共通担保(全店)金利入札
			60,032
			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.
			10/10-10/10 10,006.
			※成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日と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。

<10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	-----	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020	3M	+0.055000	1Y	買気配 -0.130
1M	売気配 -0.020				

<10月19日のJIB市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	177,162	-11,401
有担保	27,530	-759
無担保	149,632	-10,642

<10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	-0.085	-0.003	-0.010	±0					-0.094	+0.002
トムネ				-----					-0.095	+0.005
スポネ				-----						
1週間物	-0.013	-0.010	-0.012	+0.010					-0.131	+0.009
2週間物	-0.030	-0.015	-0.020	+0.016					-0.152	+0.005
3週間物				-----					-0.160	+0.006
1ヶ月物				-----					-0.168	+0.006
3ヶ月物				-----					-0.196	+0.001
6ヶ月物				-----					-0.125	+0.002
1年物				-----					-0.087	±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