

# 東京短資デイリーレポート

2023/10/23

## <10月20日のマネタリーベース>

6,724,300
-----------

## <10月23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	5,512,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,470,200
日銀当座預金残高増減前日比	+42,600

## <10月23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		+10,400
資金過不足		+10,500
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-300	
国債補完供給	+34,100	-33,200
金融調節合計		+600
当座預金増減-②		+11,100

## <10月23日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,481,300
準備預金残高	4,791,400
積み終了先	4,788,800
超過準備	4,788,300
非準備先残高	689,900

## <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)	22,500
残り要積立額 (平均)	1,000
準備進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	25.8
進捗率乖離幅	+73.6

## <10月24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		-200
財政等要因		+3,800
資金過不足		+3,600
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+17,600
CP等買入	-400	
社債等買入		+1,000
国債補完供給	+33,200	
金融調節合計		+51,400
当座預金増減		+55,000

## <10月24日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残553兆6,300億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.005% での合いが中心か。
---

## <10月24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	5,581,300	+100,000
+40,000	5,576,300	+95,000
+35,000	5,571,300	+90,000
+30,000	5,566,300	+85,000
+25,000	5,561,300	+80,000
+20,000	5,556,300	+75,000
+15,000	5,551,300	+70,000
+10,000	5,546,300	+65,000
+5,000	5,541,300	+60,000
± 0	5,536,300	+55,000
-5,000	5,531,300	+50,000
-10,000	5,526,300	+45,000
-15,000	5,521,300	+40,000
-20,000	5,516,300	+35,000
-25,000	5,511,300	+30,000
-30,000	5,506,300	+25,000
-35,000	5,501,300	+20,000
-40,000	5,496,300	+15,000
-45,000	5,491,300	+10,000

## <10月23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(1Y-3Y)	23/10/24	4,250億 応札 11,523億 落札 4,254億	最低 +0.007% 平均 +0.009% 按分 94.1%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/10/24	4,500億 応札 11,708億 落札 4,506億	最低 +0.006% 平均 +0.008% 按分 27.1%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/10/24	6,750億 応札 13,908億 落札 6,757億	最低 +0.010% 平均 +0.012% 按分 60.4%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/10/24	2,000億 応札 4,753億 落札 2,004億	最低 +0.030% 平均 +0.033% 按分 58.0%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/24	応札 0億 落札 0億	固定利回差差 +0.165%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/10/24	応札 0億 落札 0億	固定利回差差 +0.400%
(11:50) 国債補完供給	23/10/23-23/10/24	応札 33,857億 落札 33,857億	全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/10/23-23/10/24	応札 0億 落札 0億	

## <10月23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
97,581	56,586			1,001
10/11-10/25 6,360.	10/17(1-3Y) 4,253.	45,909	776,646	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.	2/18~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	10/17(5-10Y) 6,756.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	10/17(25Y-) 1,006.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/13~ 1/14 20,008.	10/19(5-10Y) 3,010.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18-11/18 93.
1/16~ 1/16 20,009.	10/19(10-25Y) 1,005.	12/ 2-12/ 2 1,712.		2/17~ 2/17 346.
1/19~ 1/20 1,163.	(10/24(1-3Y) 4,254.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
	(10/24(3-5Y) 4,506.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
	(10/24(5-10Y) 6,757.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		
	(10/24(10-25Y) 2,004.)			
		※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)		
		国債売現先オペ		
		3,002		
		0		
		10/ 4 1,001.		
		10/12 1,000.		
		10/18 1,001.		
		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.		
		国債補完供給		
		33,857		
		10/23-10/24 0.		
		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		
		CP買入額(月初末)		
		4,000		
		10/17 4,000.		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		(10/24 1,001.)		
		貸出増加支援		
		702,255		
		手形売出		
		0		
		国債売現先		
		0		
		国債補完供給		
		33,857		
		国債売現先(米ドル担保)		
		0		
		供給額合計		
		963,164		
		吸収額合計		
		33,857		
		差し引き		
		929,307		

※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。

## <10月23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	+0.025000	3M	買気配 -0.150
1W	売気配 -0.020	2M	+0.040000	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020	3M	+0.053000	1Y	買気配 -0.020
1M	売気配 -0.020				

## <10月20日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	177,856	+694
有担保	27,606	+76
無担保	150,250	+618

## <10月23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	-0.080	0.001	-0.012	-0.002					-0.098	-0.004
トムネ				-----					-0.100	-0.005
スポネ				-----						
1週間物	-0.040	-0.010	-0.020	-0.008					-0.130	+0.001
2週間物	-0.020	0.005	-0.017	+0.003					-0.151	+0.001
3週間物				-----					-0.159	+0.001
1ヶ月物				-----					-0.168	± 0
3ヶ月物				-----					-0.193	+0.003
6ヶ月物				-----					-0.116	+0.009
1年物				-----					-0.082	+0.005

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