東京短資デイリーレポート　2023/10/26

＜10月25日のマネタリーベース＞

6,770,800

＜10月26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	5,550,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,516,400
日銀当座預金残高増減前日比	+34,500

＜10月26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		-1,300
財政等要因		-200
資金過不足		-1,500
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-300	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+36,300	-38,200
金融調節合計		-2,300
当座預金増減-②		-3,800

＜10月26日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高 （①+②）	5,512,600
準備預金残高	4,818,600
積み終了先	4,816,100
超過準備	4,816,100
非準預先残高	694,000

＜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）	15,100
残り要積立額（平均）	800
準預進捗率(%)	99.6
日数進捗率(%)	35.5
進捗率乖離幅	+64.1

＜10月27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		+1,100
資金過不足		+700
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-300	
国債補完供給	+38,200	
金融調節合計		+37,900
当座預金増減		+38,600

＜10月27日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
（当預残555兆1,200億円）で
無担保コール0/Nは-0.025%～-0.010%
での出合いが中心か。

＜10月27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	5,596,200	+83,600
+40,000	5,591,200	+78,600
+35,000	5,586,200	+73,600
+30,000	5,581,200	+68,600
+25,000	5,576,200	+63,600
+20,000	5,571,200	+58,600
+15,000	5,566,200	+53,600
+10,000	5,561,200	+48,600
+5,000	5,556,200	+43,600
± 0	5,551,200	+38,600
-5,000	5,546,200	+33,600
-10,000	5,541,200	+28,600
-15,000	5,536,200	+23,600
-20,000	5,531,200	+18,600
-25,000	5,526,200	+13,600
-30,000	5,521,200	+8,600
-35,000	5,516,200	+3,600
-40,000	5,511,200	-1,400
-45,000	5,506,200	-6,400

＜10月26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)	23/10/27		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.150%	
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/10/27		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.405%	
(10:40) ＣＰ買入	23/10/31	4,000億	応札	7,355億	落札	4,000億	最低	0.000% 平均	+0.023% 按分 83.5%
(11:50) 国債補完供給	23/10/26-23/10/27		応札	38,994億	落札	38,994億	全取	-0.350% 平均	-0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/10/26-23/10/27		応札	20億	落札	20億	全取	-0.350% 平均	-0.350%

＜10月26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
９８，２８２

10/25~11/ 8	7,061.
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
７０，０３５

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.
10/25~10/25	10,003.

国債補完供給
３９，０１４

10/26~10/27	38,994.
10/26~10/27	20.

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.

国債買入額(月初来)
７８，１１３

10/19(5-10Y)	3,010.
10/19(10-25Y)	1,005.
10/24(1-3Y)	4,254.
10/24(3-5Y)	4,506.
10/24(5-10Y)	6,757.
10/24(10-25Y)	2,004.
10/25(5-10Y)	3,001.
10/25(10-25Y)	1,005.

※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

10/17	4,000.
(10/31	4,000.)

社債買入額(月初来)
１，００１

10/24	1,001.

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

10/26~11/ 2	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)
４，００５

10/ 4	1,001.
10/12	1,000.
10/18	1,001.
10/25	1,003.

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.

＜10月26日 日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	98,282	CP等買入(推定)	22,600
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	64,600
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	973,868	国債補完供給	39,014
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	973,868	吸収額合計	39,014
差し引き	934,854		

※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26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	+0.007000	3M	買気配 -0.150
1W	売気配 -0.020	2M	+0.008000	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020	3M	+0.060000	1Y	買気配 -0.130
1M	売気配 -0.020				

＜10月25日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)＞

	残高	増減
市場合計	178,539	-30
有担保	28,380	+932
無担保	150,159	-962

＜10月26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	-0.005	-0.019	-0.001				------	-0.099	-0.002
トムネ				------				------	-0.119	-0.018
スポネ				------				------		
1週間物	-0.040	0.000	-0.028	-0.002				------	-0.146	-0.005
2週間物	-0.020	0.030	-0.001	+0.019				------	-0.157	± 0
3週間物				------				------	-0.161	+0.002
1ヶ月物				------				------	-0.168	+0.001
3ヶ月物				------				------	-0.191	± 0
6ヶ月物				------				------	-0.113	± 0
1年物				------				------	-0.081	± 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