東京短資デイリーレポート　2024/9/13

＜9月12日のマネタリーベース＞

6,666,500

＜9月13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	5,431,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,425,000
日銀当座預金残高増減前日比	+6,100

＜9月13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		-700
資金過不足		-800
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+15,700	-14,500
貸出増加支援	-128,300	+121,500
金融調節合計		-5,800
当座預金増減-②		-6,600

＜9月13日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高（①+②）	5,418,400
準備預金残高	4,857,600
積み終了先	4,857,600
超過準備	4,857,600
非準預先残高	560,800

＜参考＞

翌積み期間所要準備額（積数）	3,940,700
翌積み期間所要準備額（平均）	131,400
残り要積立額（積数）	462,800
残り要積立額（平均）	16,000
準預進捗率(%)	88.2
日数進捗率(%)	3.3
進捗率乖離幅	+84.9

＜9月17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		+7,400
資金過不足		+7,600
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補完供給	+14,500	
金融調節合計		+14,400
当座預金増減		+22,000

＜9月17日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残543兆1,100億円)で
無担保コール0/Nは+0.225%～+0.228%
での出合いが中心か。

＜9月17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	5,485,400	+67,000
+40,000	5,480,400	+62,000
+35,000	5,475,400	+57,000
+30,000	5,470,400	+52,000
+25,000	5,465,400	+47,000
+20,000	5,460,400	+42,000
+15,000	5,455,400	+37,000
+10,000	5,450,400	+32,000
+5,000	5,445,400	+27,000
± 0	5,440,400	+22,000
-5,000	5,435,400	+17,000
-10,000	5,430,400	+12,000
-15,000	5,425,400	+7,000
-20,000	5,420,400	+2,000
-25,000	5,415,400	-3,000
-30,000	5,410,400	-8,000
-35,000	5,405,400	-13,000
-40,000	5,400,400	-18,000
-45,000	5,395,400	-23,000

＜9月13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。

(11:50) 国債補完供給	24/ 9/13-24/ 9/17	応札 14,762億	落札 14,762億	全取 -0.050%	平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/ 9/13-24/ 9/17	応札 0億	落札 0億		

＜9月13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
99,225

9/ 4~ 9/18	8,004.
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.

国債買入額(月初来)
27,040

9/ 9(5-10Y)	4,006.
9/ 9(10-25Y)	1,504.
9/ 9(25Y-)	753.
9/12(1-3Y)	3,505.
9/12(3-5Y)	3,752.
9/12(5-10Y)	4,008.
9/12(25Y-)	753.

※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

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
14,762

9/13~ 9/17	14,762.
9/13~ 9/17	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.

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
29,719

12/ 2~12/ 2	1,712.
3/ 3~ 3/ 3	6,793.
6/ 2~ 6/ 2	2,644.
9/ 1~ 9/ 1	5,024.
12/ 1~12/ 1	2,464.
3/ 2~ 3/ 2	7,922.
6/ 3~ 6/ 3	3,160.
12/ 4~12/ 4	3,325.

※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
12,401百万ﾄﾞﾙ

12/ 4~12/ 4	3,325.
3/ 4~ 3/ 4	2,097.
6/ 3~ 6/ 3	5,318.
9/ 5~ 9/ 5	1,661.

国債買現先オペ
0

国債売現先オペ
0

ＣＰ買入額(月初来)
0

社債買入額(月初来)
0

貸出増加支援資金供給
857,802

12/15~12/13	54,701.
3/17~ 3/17	64,498.
6/18~ 6/18	26,498.
9/15~ 9/12	27,659.

※直近約1年分の期落ち分を記載

米ドル資金供給オペ
1百万ﾄﾞﾙ

9/12~ 9/19	1.

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)
0

被災地金融機関支援資金供給
899

11/18~11/18	93.
2/17~ 2/17	346.
5/17~ 5/12	0.
5/12~ 5/12	181.
8/19~ 8/18	279.
8/18~ 8/18	0.
11/17~11/17	0.
2/16~ 2/16	0.

気候変動対応支援資金供給
119,629

1/30~ 1/30	47,268.
7/19~ 7/18	72,361.

＜9月13日 日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	99,225	CP等買入(推定)	20,000
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	55,900
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	899		
気候変動対応支援	119,626		
成長基盤支援	25,272	手形売出	0
貸出増加支援	783,814	国債売現先	0
供給オペ合計	1,098,871	国債補完供給	14,762
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	1,098,871	吸収額合計	14,762
差し引き	1,084,109		

※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13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	売気配 +0.200	1M	買気配 +0.2600	3M	買気配 +0.130
1W	売気配 +0.200	2M	------	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	------	1Y	買気配 +0.280
1M	売気配 +0.200				

＜9月12日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)

	残高	増減
市場合計	118,621	-2,062
有担保	39,381	-1,585
無担保	79,240	-477

＜9月13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	0.215	0.275	0.227	-0.002				------	0.244	+0.007
トムネ				------				------	0.243	+0.036
スポネ				------				------		
1週間物			0.227	------				------	0.201	+0.003
2週間物				------				------	0.198	-0.001
3週間物				------				------	0.197	± 0
1ヶ月物	0.340	0.430	0.388	+0.063				------	0.198	± 0
3ヶ月物				------				------	0.203	± 0
6ヶ月物				------				------	0.251	± 0
1年物				------				------	0.317	± 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