東京短資デイリーレポート　2024/9/30

＜9月27日のマネタリーベース＞

6,723,800

＜9月30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	5,513,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,483,000
日銀当座預金残高増減前日比	+30,200

＜9月30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		+500
財政等要因		+9,300
資金過不足		+9,800
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-3,100	+4,000
国債補完供給	+15,300	-14,700
金融調節合計		+1,500
当座預金増減-②		+11,300

＜9月30日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高（①+②）	5,494,300
準備預金残高	4,950,800
積み終了先	4,950,000
超過準備	4,950,000
非準預先残高	543,500

＜参考＞

今積み期間所要準備額（積数）	3,940,700
今積み期間所要準備額（平均）	131,400
残り要積立額（積数）	4,200
残り要積立額（平均）	300
準預進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	50.0
進捗率乖離幅	+49.8

＜10月1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		-500
財政等要因		-25,200
資金過不足		-25,700
金融調節確定分		
	期落	新規
国債補完供給	+14,700	
金融調節合計		+14,700
当座預金増減		-11,000

＜10月1日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
（当預残548兆3,300億円）で
無担保コール0/Nは+0.220%～+0.275%
での出合いが中心か。

＜10月1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	5,528,300	+34,000
+40,000	5,523,300	+29,000
+35,000	5,518,300	+24,000
+30,000	5,513,300	+19,000
+25,000	5,508,300	+14,000
+20,000	5,503,300	+9,000
+15,000	5,498,300	+4,000
+10,000	5,493,300	-1,000
+5,000	5,488,300	-6,000
± 0	5,483,300	-11,000
-5,000	5,478,300	-16,000
-10,000	5,473,300	-21,000
-15,000	5,468,300	-26,000
-20,000	5,463,300	-31,000
-25,000	5,458,300	-36,000
-30,000	5,453,300	-41,000
-35,000	5,448,300	-46,000
-40,000	5,443,300	-51,000
-45,000	5,438,300	-56,000

＜9月30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/ 9/30-24/10/ 1	応札 14,916億 落札 14,916億 全取 -0.050% 平均 -0.050%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 9/30-24/10/ 1	応札 0億 落札 0億	

＜9月30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

99,227

9/18~10/ 2	8,006.
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)

53,160

9/26(1-3Y)	3,501.
9/26(3-5Y)	3,754.
9/26(5-10Y)	4,003.
9/26(10-25Y)	1,500.
9/26(物国)	601.

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.

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

0百万ﾄﾞﾙ

9/26~10/ 3	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.

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.

※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

国債売現先オペ

0

国債売現先(米ドルオペ用担保)

0

国庫短期証券買入額(月初来)

0

国債補完供給

14,916

9/30~10/ 1	14,916.
9/30~10/ 1	0.

ＣＰ買入額(月初来)

3,995

9/30	3,995.

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

社債買入額(月初来)

500

9/20	500.

＜9月30日 日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	99,227	CP等買入(推定)	19,000
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	55,000
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	25,566	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	1,099,167	国債補完供給	14,916
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	1,099,167	吸収額合計	14,916
		差し引き	1,084,251

※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30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	+0.200	1M	------	3M	買気配 +0.100
1W	売気配 +0.200	2M	+0.317000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	------	1Y	買気配 +0.150
1M	売気配 +0.200				

＜9月27日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)＞

	残高	増減
市場合計	108,573	-5,088
有担保	39,878	-1,624
無担保	68,695	-3,464

＜9月30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	0.217	0.228	0.225	-0.001				------	0.232	-0.012
トムネ				------				------	0.238	+0.030
スポネ				------				------		
1週間物	0.227	0.269	0.232	------				------	0.199	± 0
2週間物				------				------	0.199	+0.001
3週間物				------				------	0.198	± 0
1ヶ月物			0.300	-0.008				------	0.199	± 0
3ヶ月物				------				------	0.207	± 0
6ヶ月物				------				------	0.250	+0.001
1年物				------				------	0.318	+0.001

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