

東京短資デイリーレポート

2024/10/1

<9月30日のマネタリーベース>

6,734,600

<10月1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	5,483,300	
前日の日銀当座預金残高-①	5,494,300	
日銀当座預金残高増減前日比	-11,000	

<10月1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	-600
財政等要因	-28,300
資金過不足	-28,900
金融調節	
国債補完供給	+14,700
金融調節合計	+200
当座預金増減-②	-28,700

<10月1日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,465,600
準備預金残高	4,941,600
積み終了先	4,940,700
超過準備	4,940,700
非準備先残高	524,000

<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)	3,300
残り要積立額 (平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	53.3
進捗率乖離幅	+46.6

<10月2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	-51,200
資金過不足	-50,800
金融調節確定分	
共通担保(全店)	-8,000
国債補完供給	+14,500
金融調節合計	+14,500
当座預金増減	-36,300

<10月2日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残542兆9,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.277% での合いが中心か。

<10月2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	5,474,300	+8,700
+40,000	5,469,300	+3,700
+35,000	5,464,300	-1,300
+30,000	5,459,300	-6,300
+25,000	5,454,300	-11,300
+20,000	5,449,300	-16,300
+15,000	5,444,300	-21,300
+10,000	5,439,300	-26,300
+5,000	5,434,300	-31,300
± 0	5,429,300	-36,300
-5,000	5,424,300	-41,300
-10,000	5,419,300	-46,300
-15,000	5,414,300	-51,300
-20,000	5,409,300	-56,300
-25,000	5,404,300	-61,300
-30,000	5,399,300	-66,300
-35,000	5,394,300	-71,300
-40,000	5,389,300	-76,300
-45,000	5,384,300	-81,300

<10月1日 日銀オペ入札結果>

時間	種別	期間	応募	1mL	落札	1mL	貸付	率
(10:40)	米ドル資金供給	24/10/ 3-24/10/10	応札	1mL	落札	1mL	貸付	5.070%
(11:50)	国債補完供給	24/10/ 1-24/10/ 2	応札	14,720億	落札	14,720億	全取	-0.050% 平均 -0.050%
(13:00)	共通担保(全)国	24/10/ 2-24/10/16	8,000億	応札	12,183億	落札	8,006億	貸付 0.250% 按分 65.7%
(13:50)	国債補完供給	24/10/ 1-24/10/ 2	応札	79億	落札	79億	全取	-0.050% 平均 -0.050%

<10月1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	
9,9227	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
9/18-10/ 2 8,006.	9/26(1-3Y) 3,501.	29,719	857,802	11/18-11/18 93.
(10/ 2-10/16 8,006.)	9/26(3-5Y) 3,754.	12/ 2-12/ 2 1,712.	12/15-12/13 54,701.	2/17- 2/17 346.
1/ 5- 1/ 6 10,016.	9/26(5-10Y) 4,003.	3/ 3- 3/ 3 6,793.	3/17- 3/17 64,498.	5/17- 5/12 0.
1/ 6- 1/ 6 20,014.	9/26(10-25Y) 1,500.	6/ 2- 6/ 2 2,644.	6/18- 6/18 26,498.	5/12- 5/12 181.
1/10- 1/10 20,011.	9/26(物国) 601.	9/ 1- 9/ 1 5,024.	9/15- 9/12 27,659.	8/19- 8/18 279.
1/13- 1/14 20,008.		12/ 1-12/ 1 2,464.		8/18- 8/18 0.
1/16- 1/16 20,009.		3/ 2- 3/ 2 7,922.		11/17-11/17 0.
1/19- 1/20 1,163.		6/ 3- 6/ 3 3,160.		2/16- 2/16 0.
		12/ 4-12/ 4 3,325.		
			9/26-10/ 3 0.	
			(10/ 3-10/10 1.)	
			成長基盤強化支援米ドル特別	
			12,401百万ドル	
			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(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	
			0	
			CP買入額(月初末)	
			0	
			社債買入額(月初末)	
			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.	

※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1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	+0.320000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.200				

<9月30日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計		
	残高	増減
市場合計	106,923	-1,650
有担保	38,592	-1,286
無担保	68,331	-364

<10月1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	0.220	0.290	0.227	+0.002				-----	0.242	+0.010
トムネ				-----				-----	0.239	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.234	0.390	0.250	+0.018				-----	0.202	+0.003
2週間物	0.227	0.400	0.270	-----				-----	0.200	+0.001
3週間物				-----				-----	0.200	+0.002
1ヶ月物	0.280	0.285	0.283	-0.017				-----	0.200	+0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.207	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.252	+0.002
1年物				-----				-----	0.318	± 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