

東京短資デイリーレポート

2024/10/16

<10月15日のマネタリーベース>

6,716,700

<10月16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	5,479,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,476,100
日銀当座預金残高増減前日比	+3,800

<10月16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	+700
財政等要因	-6,500
資金過不足	-5,800
金融調節	
共通担保(全店)	-8,000
社債等買入	-200
国債補完供給	+9,700
金融調節合計	+300
当座預金増減-②	-5,500

<10月16日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,470,600
準備預金残高	4,899,200
積み終了先	3,515,300
超過準備	1,375,000
非準備先残高	571,400

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,041,000
今積み期間所要準備額(平均)	130,400
残り要積立額(積数)	516,800
残り要積立額(平均)	17,200
準備進捗率(%)	87.2
日数進捗率(%)	3.2
進捗率乖離幅	+84.0

<10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	-400
財政等要因	+5,500
資金過不足	+5,100
金融調節確定分	
国債補完供給	+9,200
金融調節合計	+9,200
当座預金増減	+14,300

<10月17日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆4,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<10月17日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,529,900	+59,300
+40,000	5,524,900	+54,300
+35,000	5,519,900	+49,300
+30,000	5,514,900	+44,300
+25,000	5,509,900	+39,300
+20,000	5,504,900	+34,300
+15,000	5,499,900	+29,300
+10,000	5,494,900	+24,300
+5,000	5,489,900	+19,300
±0	5,484,900	+14,300
-5,000	5,479,900	+9,300
-10,000	5,474,900	+4,300
-15,000	5,469,900	-700
-20,000	5,464,900	-5,700
-25,000	5,459,900	-10,700
-30,000	5,454,900	-15,700
-35,000	5,449,900	-20,700
-40,000	5,444,900	-25,700
-45,000	5,439,900	-30,700

<10月16日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/10/16-24/10/17	応札 9,500億 落札 9,500億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/10/16-24/10/17	応札 0億 落札 0億

<10月16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(月初来)	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
9,227	29,049	成長基盤強化支援資金供給	899
10/16-10/30 8,006.	10/15(1-3Y) 3,254.	貸出増加支援資金供給	899
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	10/15(5-10Y) 3,753.	12/ 2-12/ 2 1,712.	11/18-11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	10/15(10-25Y) 1,503.	12/15-12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	8/19~ 8/18 279.
1/19~ 1/20 1,163.		12/ 1-12/ 1 2,464.	8/18~ 8/18 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	11/17-11/17 0.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	2/16~ 2/16 0.
		12/ 4-12/ 4 3,325.	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	
		10/10-10/17 0.	
		(10/17-10/24 0.)	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	
		成長基盤強化支援ドル特別	
		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.	
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売入先(米ドルオペ用担保)	
		0	
		国債売入先オペ	
		0	
		国債買入額(固定利回)(月初来)	
		0	
		CP買入額(月初来)	
		0	
		社債買入額(月初来)	
		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	

※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16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		1M		3M	
	+0.200	1M	+0.256000	3M	買気配 +0.100
1W	売気配 +0.200	2M	+0.270000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	+0.299000	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.200				

<10月15日のJ-REIT市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	113,878	+1,777
有担保	39,509	-533
無担保	74,369	+2,310

<10月16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	0.227	0.227	±0				-----	0.240	+0.004
トムネ				-----				-----	0.239	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.201	-0.001
2週間物	0.227	0.400	0.243	-0.057				-----	0.201	±0
3週間物				-----				-----	0.201	±0
1ヶ月物			0.300	-----				-----	0.202	±0
3ヶ月物	0.310	0.330	0.316	+0.006				-----	0.209	±0
6ヶ月物				-----				-----	0.255	+0.001
1年物				-----				-----	0.320	+0.002

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