

東京短資デイリーレポート

2024/2/9

<2月8日のマナリーベース>

6,596,200

<2月9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	5,387,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,336,000
日銀当座預金残高増減前日比	+51,600

<2月9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		+800
財政等要因		+4,500
資金過不足		+5,300
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+14,300
CP等買入	-100	
国債補完供給	+31,600	-33,400
金融調節合計		+12,400
当座預金増減-②		+17,700

<2月9日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,353,700
準備預金残高	4,673,100
積み終了先	4,672,900
超過準備	4,672,700
非準備先残高	680,600

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,044,000
今積み期間所要準備額 (平均)	130,500
残り要積立額 (積数)	100
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	90.3
進捗率乖離幅	+9.6

<2月13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		+300
財政等要因		-26,900
資金過不足		-26,600
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買現先		+29,800
CP等買入	-500	
国債補完供給	+33,400	
金融調節合計		+62,700
当座預金増減		+36,100

<2月13日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残538兆9,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.013%~-0.003% での合いが中心か。

<2月13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	5,434,800	+81,100
+40,000	5,429,800	+76,100
+35,000	5,424,800	+71,100
+30,000	5,419,800	+66,100
+25,000	5,414,800	+61,100
+20,000	5,409,800	+56,100
+15,000	5,404,800	+51,100
+10,000	5,399,800	+46,100
+5,000	5,394,800	+41,100
±0	5,389,800	+36,100
-5,000	5,384,800	+31,100
-10,000	5,379,800	+26,100
-15,000	5,374,800	+21,100
-20,000	5,369,800	+16,100
-25,000	5,364,800	+11,100
-30,000	5,359,800	+6,100
-35,000	5,354,800	+1,100
-40,000	5,349,800	-3,900
-45,000	5,344,800	-8,900

<2月9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/ 2/ 9-24/ 2/13	応札 33,656億 落札 33,656億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	24/ 2/ 9-24/ 2/13	応札 0億 落札 0億
(12:50) 国債買現先	24/ 2/13-24/ 2/14	30,000億 応札 36,350億 落札 30,005億 最低 -0.100% 平均 -0.096% 按分 74.5%

<2月9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	
98,693	28,547	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
		16,426百万ドル	1,001	
2/ 7~ 2/21 7,472.	2/ 5(-1Y) 1,500.	3 5,651	8 07,139	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/ 5(1-3Y) 3,759.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/ 5(3-5Y) 4,256.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.	2/ 5(5-10Y) 4,755.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.	2/ 9(1-3Y) 3,755.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.	2/ 9(3-5Y) 4,255.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	2/ 9(5-10Y) 4,758.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
	2/ 9(10-25Y) 1,509.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.		
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			4百万ドル	
			2/ 8~ 2/15 4.	
			※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別	
			16,426百万ドル	
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.	
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.	
			12/ 4~12/ 4 3,325.	
			国債買現先オペ	
			31,100	
			(2/13~ 2/14 30,005.)	
			2/ 6~ 2/16 31,100.	
			国債売現先オペ(米ドルオペ用担保)	
			2	
			2/ 7~ 2/16 2.	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			国債売現先オペ	
			1,000	
			2/ 7 1,000.	
			※直近約1週間の実施分を記載	
			国債買入額(固定利回)(月初末)	
			0	
			国債補完供給	
			33,656	
			2/ 9~ 2/13 33,656.	
			2/ 9~ 2/13 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	
			CP買入額(月初末)	
			0	
			(2/14 3,999.)	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			<2月9日 日銀信用概算(除く買切)>	
			共通担保(全)固定 98,693	CP等買入(推定) 24,200
			共通担保(全)金入 70,035	社債等買入(推定) 60,700
			国債買現先 31,100	
			被災地金融機関支援 1,001	
			気候変動対応支援 81,666	
			成長基盤支援 30,589	手形売出 0
			貸出増加支援 730,665	国債売現先 0
			供給オペ合計 1,043,749	国債補完供給 33,656
			貸出(推定) 0	国売現(米ドル担保) 2
			供給額合計 1,043,749	吸収額合計 33,658
			差し引き 1,010,091	

※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。

<2月9日のオープン市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP買現先		CPプライマリー		TBアウトライト	
S/N	0.000	1M	+0.020000	3M	買気配 -0.090
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.090
2W	売気配 -0.020	3M	+0.100000	1Y	買気配 -0.090
1M	売気配 -0.020				

<2月8日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	198,327	-2,114
有担保	29,496	-242
無担保	168,831	-1,872

<2月9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	-0.086	0.001	-0.005	±0				-----	-0.074	+0.002
トムネ			-0.002	-0.001				-----	-0.053	+0.021
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.015	-0.009	-0.012	+0.015				-----	-0.075	+0.006
2週間物				-----				-----	-0.083	+0.006
3週間物				-----				-----	-0.088	+0.007
1ヶ月物				-----				-----	-0.096	+0.005
3ヶ月物	0.030	0.050	0.040	-----				-----	-0.112	+0.006
6ヶ月物				-----				-----	-0.082	+0.005
1年物				-----				-----	-0.048	+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