

東京短資デイリーレポート

2024/2/14

<2月13日のマナタリーベース>

6,607,900

<2月14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	5,357,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,348,700
日銀当座預金残高増減前日比	+9,200

<2月14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	-4,200
資金過不足	-3,700
金融調節	
国庫短期証券買入	期落 新規 +1,000
国債買現先	-29,800
CP等買入	-100 +4,000
国債補完供給	+35,800 -31,900
金融調節合計	-21,000
当座預金増減-②	-24,700

<2月14日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,324,000
準備預金残高	4,654,200
積み終了先	4,654,200
超過準備	4,654,100
非準備先残高	669,800

<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)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率 (%)	100.0
日数進捗率 (%)	96.8
進捗率乖離幅	+3.2

<2月15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	0
財政等要因	+67,700
資金過不足	+67,700
金融調節確定分	
国債買現先	期落 新規 +24,400
CP等買入	-700
国債補完供給	+31,900
貸出増加支援	-300
金融調節合計	+55,300
当座預金増減	+123,000

<2月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残544兆7,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.013%~-0.003% での合いが中心か。

<2月15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	5,492,000	+168,000
+40,000	5,487,000	+163,000
+35,000	5,482,000	+158,000
+30,000	5,477,000	+153,000
+25,000	5,472,000	+148,000
+20,000	5,467,000	+143,000
+15,000	5,462,000	+138,000
+10,000	5,457,000	+133,000
+5,000	5,452,000	+128,000
±0	5,447,000	+123,000
-5,000	5,442,000	+118,000
-10,000	5,437,000	+113,000
-15,000	5,432,000	+108,000
-20,000	5,427,000	+103,000
-25,000	5,422,000	+98,000
-30,000	5,417,000	+93,000
-35,000	5,412,000	+88,000
-40,000	5,407,000	+83,000
-45,000	5,402,000	+78,000

<2月14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/ 2/14-24/ 2/15	応札 32,235億 落札 32,235億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	24/ 2/14-24/ 2/15	応札 0億 落札 0億
(9:30) 国債買現先	24/ 2/15-24/ 2/16	25,000億 応札 36,750億 落札 25,003億 最低 -0.100% 平均 -0.090% 按分 5.3%
(9:30) 被災地金融機関支援	24/ 2/16-26/ 2/16	0億 貸付 0.000%

<2月14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)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	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	1,001
2/ 7~ 2/21 7,472.	2/ 9(1-3Y) 3,755.	35,651	807,139	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/ 9(3-5Y) 4,255.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/ 9(5-10Y) 4,758.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.	2/ 9(10-25Y) 1,509.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.		12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.		2/16~ 2/16 0.)
			※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.	
			(2/15~ 2/22 1.)	
			※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/ 6~ 2/16 31,100.	
			(2/15~ 2/16 25,003.)	
			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)	
			2,000	
			2/ 7 1,000.	
			2/14 1,000.	
			国債売現先オペ	
			0	
			2/ 7 1,000.	
			2/14 1,000.	
			CP買入額(月初末)	
			3,999	
			2/14 3,999.	
			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.	
			※直近約1週間の実施分を記載	

<2月14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)	27,700
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	60,600
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	32,235
貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	2
供給額合計	1,043,749	吸収額合計	32,237
		差し引き	1,011,512

※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14日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	1M	3M	1M	3M	1Y	3M
0.000	1M	+0.010000	3M	買気配 -0.080		
1W 売気配 -0.020	2M	+0.020000	6M	買気配 -0.080		
2W 売気配 -0.020	3M	+0.100000	1Y	買気配 0.000		
1M 売気配 -0.020						

<2月13日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高		増減
	市場合計	有担保	
市場合計	186,094	29,427	+1,815
有担保	29,427		-698
無担保	156,667		+2,513

<2月14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	-0.075	0.001	-0.005	±0					-0.059	+0.011
トムネ			-0.002	+0.001					-0.062	±0
スポネ										
1週間物	-0.010	0.001	-0.004	-0.003					-0.070	+0.002
2週間物			-0.010	-0.008					-0.079	+0.001
3週間物			0.010						-0.085	+0.001
1ヶ月物	-0.001	0.200	0.086						-0.089	+0.002
3ヶ月物			0.050	+0.020					-0.098	+0.006
6ヶ月物									-0.073	+0.006
1年物									-0.043	+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