

# 東京短資デイリーレポート

2024/2/16

## <2月15日のマネタリーベース>

6,668,700
-----------

## <2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	5,404,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,409,900
日銀当座預金残高増減前日比	-5,900

## <2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		0
財政等要因		+4,000
資金過不足		+4,000
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+10,300
国債買現先	-54,000	
CP等買入	-200	
国債補完供給	+35,200	-38,000
金融調節合計		-46,700
当座預金増減-②		-42,700

## <2月16日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,367,200
準備預金残高	4,697,600
積み終了先	4,681,100
超過準備	3,458,500
非準備先残高	669,600

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,772,800
今積み期間所要準備額(平均)	130,100
残り要積立額(積数)	55,700
残り要積立額(平均)	2,100
準備進捗率(%)	98.5
日数進捗率(%)	10.3
進捗率乖離幅	+88.2

## <2月19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		-5,200
資金過不足		-4,800
金融調節確定分		
	期落	新規
国債補完供給	+38,000	
金融調節合計		+38,000
当座預金増減		+33,200

## <2月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残540兆400億円)で 無担保コール0/Nは-0.012%~-0.002% での合いが中心か。
---

## <2月19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	5,445,400	+78,200
+40,000	5,440,400	+73,200
+35,000	5,435,400	+68,200
+30,000	5,430,400	+63,200
+25,000	5,425,400	+58,200
+20,000	5,420,400	+53,200
+15,000	5,415,400	+48,200
+10,000	5,410,400	+43,200
+5,000	5,405,400	+38,200
±0	5,400,400	+33,200
-5,000	5,395,400	+28,200
-10,000	5,390,400	+23,200
-15,000	5,385,400	+18,200
-20,000	5,380,400	+13,200
-25,000	5,375,400	+8,200
-30,000	5,370,400	+3,200
-35,000	5,365,400	-1,800
-40,000	5,360,400	-6,800
-45,000	5,355,400	-11,800

## <2月16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。

(10:40) 社債買入	24/ 2/21	1,000億	応札 1,591億	落札 1,000億	最低 +0.292%	平均 +0.316%	按分 55.4%
(11:50) 国債補完供給	24/ 2/16-24/ 2/19		応札 38,315億	落札 38,315億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 2/16-24/ 2/19		応札 0億	落札 0億			

## <2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		
98,693	38,815	成長基盤強化支援資金供給 16,426百万ドル	1,001		
2/ 7~ 2/21 7,472.	2/ 9(1-3Y) 3,755.	3 5,651	8 07,139	5/17~ 5/17 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.	8/19~ 8/19 381.	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/ 9(5-10Y) 4,758.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.	
1/10~ 1/10 20,011.	2/ 9(10-25Y) 1,509.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.	
1/13~ 1/14 20,008.	2/16(1-3Y) 3,754.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	5/12~ 5/12 181.	
1/16~ 1/16 20,009.	2/16(3-5Y) 4,256.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		8/18~ 8/18 0.	
1/19~ 1/20 1,163.	2/16(10-25Y) 1,503.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		11/17~11/17 0.	
	2/16(25Y-) 755.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		2/16~ 2/16 0.	
		12/ 1~12/ 1 2,464.			
		※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			
		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)			
		国債売現先オペ			
		0			
		2/ 7 1,000.			
		2/14 1,000.			
		CP買入額(月初来)			
		3,999			
		2/14 3,999.			
		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			
		国債補完供給			
		38,315			
		2/16~ 2/19 38,315.			
		2/16~ 2/19 0.			
		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(月初来)			
		2,000			
		2/ 7 1,000.			
		2/14 1,000.			
		社債買入額(月初来)			
		0			
		( 2/21 1,000.)			
		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。			
		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	1,012,649	国債補完供給	38,315
		貸出(推定)	0	貸出(推定)	0
		供給額合計	1,012,649	吸収額合計	38,315
		差し引き	974,334		

## <2月16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	3M	6M
0.000	1M	3M	1M	3M	3M	6M
1W 売気配 -0.020						
2W 売気配 -0.020						
1M 売気配 -0.020						

## <2月15日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	179,102	+2,192
有担保	28,504	+27
無担保	150,598	+2,165

## <2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	-0.087	0.001	-0.006	-0.001					-0.080	-0.005
トムネ			-0.003	±0					-0.080	+0.003
スポネ										
1週間物	-0.013	-0.001	-0.005	±0					-0.084	-0.001
2週間物	-0.010	0.000	-0.007	+0.002					-0.089	-0.002
3週間物									-0.091	-0.002
1ヶ月物	-0.013	0.010	-0.003	-0.008					-0.095	-0.001
3ヶ月物									-0.095	+0.002
6ヶ月物									-0.071	+0.002
1年物									-0.043	±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