

東京短資デイリーレポート

2024/2/26

<2月22日のマネタリーベース>

Table with 1 row and 1 column containing the value 6,632,600.

<2月26日9時20分日銀オペ後の状況>

Table showing 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 (5,403,700), 前日の日銀当座預金残高 (5,372,300), and 日銀当座預金残高増減前日比 (+31,400).

<2月26日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

Table detailing financial adjustments including 資金需給実績 (銀行券要因 +200, 財政等要因 -3,200, 資金過不足 -3,000) and 金融調節 (CP等買入 -300, 国債補完供給 +34,100, 金融調節合計 +300, 当座預金増減 -2,700).

<2月26日の日銀当座預金状況>

Table showing 当座預金残高 (5,369,600), 準備預金残高 (4,684,600), 積み終了先 (4,683,400), 超過準備 (4,682,500), and 非準備先残高 (685,000).

<参考>

Table with 6 rows of reference data including 今積み期間所要準備額 (積数) 3,772,800, 残り要積立額 (積数) 13,500, 進捗率乖離幅 +61.7, etc.

<2月27日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

Table detailing financial adjustments for Feb 27, including 資金需給予想 (銀行券要因 -200, 財政等要因 +1,800, 資金過不足 +1,600) and 金融調節確定分 (国債補完供給 +33,500, 金融調節合計 +33,500, 当座預金増減 +35,100).

<2月27日のオペ予想>

Table with 3 rows of operational expectations, including 朝一の金融調節はノーオペ (当預残540兆4,700億円) and 無担保コール0/Nは-0.010%~-0.001%での合いが中心か。

<2月27日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

Table showing 9時20分のオペ (日銀当座預金残高, 前日比増減) with values ranging from +45,000 to -45,000.

<2月26日 日銀オペ入札結果>

Table with 3 rows of tender results for 日銀オペ, including 10:40 C/P買入 (4,000億 応札 8,268億 落札 3,990億), 11:50 国債補完供給 (24/2/26-24/2/27 応札 33,726億 落札 33,726億), and 13:50 国債補完供給 (24/2/26-24/2/27 応札 133億 落札 133億).

<2月26日 各オペ残高と内訳>

Large table showing detailed breakdown of various operations including 共通担保(全店)固定金利, 国債買入額(月初来), 貸出増加支援資金供給, 被災地金融機関支援資金供給, 国債買現先オペ, C/P買入額(月初来), and 社債買入額(月初来).

※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26日のオープン市場気配レート(単位:%)>

Table showing open market bid rates for NCD/CP優先, CPプライマリー, and TBアウトライト across different terms (S/N, 1W, 2W, 1M).

<2月22日のコール市場残高(単位:億円)>

Table showing call market residual amounts for 市場合計 (209,778), 有担保 (30,931), and 無担保 (178,847).

<2月26日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

Table comparing call market rates (無担保コール, 有担保コール) and Tokyo Repo rates (東京レポレート) across various terms like 翌日物, トムネ, スポネ, 1週間物, etc.

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