

# 東京短資デイリーレポート

2024/2/28

## <2月27日のマナリーベース>

6,629,900
-----------

## <2月28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	5,399,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,369,700
日銀当座預金残高増減前日比	+29,700

## <2月28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	-5,400
資金過不足	-5,400
金融調節	
国庫短期証券買入	期落 新規 +1,000
CP等買入	-300
社債等買入	-200
国債補完供給	+34,000 -34,600
金融調節合計	-100
当座預金増減-②	-5,500

## <2月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,364,200
準備預金残高	4,692,100
積み終了先	4,690,400
超過準備	4,690,400
非準備先残高	672,100

## <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)	10,600
残り要積立額 (平均)	700
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	44.8
進捗率乖離幅	+54.9

## <2月29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	-100
財政等要因	+11,400
資金過不足	+11,300
金融調節確定分	
国債買入	期落 新規 +7,500
CP等買入	-2,700 +4,000
国債補完供給	+34,600
金融調節合計	+43,400
当座預金増減	+54,700

## <2月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆8,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.010%~-0.001% での出合いが中心か。
--

## <2月29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	5,463,900	+99,700
+40,000	5,458,900	+94,700
+35,000	5,453,900	+89,700
+30,000	5,448,900	+84,700
+25,000	5,443,900	+79,700
+20,000	5,438,900	+74,700
+15,000	5,433,900	+69,700
+10,000	5,428,900	+64,700
+5,000	5,423,900	+59,700
± 0	5,418,900	+54,700
-5,000	5,413,900	+49,700
-10,000	5,408,900	+44,700
-15,000	5,403,900	+39,700
-20,000	5,398,900	+34,700
-25,000	5,393,900	+29,700
-30,000	5,388,900	+24,700
-35,000	5,383,900	+19,700
-40,000	5,378,900	+14,700
-45,000	5,373,900	+9,700

## <2月28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。

(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 2/29	4,750億 応札 8,922億 落札 4,752億 最低 +0.005% 平均 +0.009% 按分 80.7%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 2/29	1,500億 応札 2,665億 落札 1,504億 最低 +0.021% 平均 +0.024% 按分 56.3%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/ 2/29	750億 応札 2,480億 落札 753億 最低 +0.034% 平均 +0.035% 按分 4.6%
(10:10) 国債買入(物国)	24/ 2/29	600億 応札 2,821億 落札 600億 按分-0.560円 平均-0.570円 按分 12.5%
(11:50) 国債補完供給	24/ 2/28-24/ 2/29	応札 34,962億 落札 34,962億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	24/ 2/28-24/ 2/29	応札 0億 落札 0億

## <2月28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)	貸出支援基金の運用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
98,343	51,585	成長基盤強化支援資金供給 1,001	1,001
2/21~ 3/ 6 7,122.	2/22(1-3Y) 3,756.	35,651	807,139
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/22(3-5Y) 4,260.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/22(5-10Y) 4,754.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/10~ 1/10 20,011.	(2/29(5-10Y) 4,752.)	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/13~ 1/14 20,008.	(2/29(10-25Y) 1,504.)	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/16~ 1/16 20,009.	(2/29(25Y-) 753.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	(2/29(物国) 600.)	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
		成長基盤強化支援米ドル特別	8百万ドル
		16,426百万ドル	2/22~ 2/29 8.
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.	(2/29~ 3/ 7 0.)
		6/ 2~ 6/ 3 5,566.	
		9/ 5~ 9/ 5 5,382.	
		12/ 4~12/ 4 3,325.	
		(3/ 4~ 3/ 4 2,097.)	
		国債買入先オペ	
		0	国債売現先(米ドルオペ用担保)
			2
			2/21~ 3/ 1 2.
			国庫短期証券買入額(月初末)
		国債売現先オペ	4,000
		0	2/ 7 1,000.
			2/14 1,000.
			2/21 1,000.
			2/28 1,000.
		CP買入額(月初末)	
		3,999	
		2/14 3,999.	
		(2/29 3,990.)	
		社債買入額(月初末)	
		1,000	
		2/21 1,000.	
		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	
		34,962	
		2/28~ 2/29 34,962.	
		2/28~ 2/29 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。	

## <2月28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 0.000	1M +0.009000	3M 買気配 -0.100
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.030
2W 売気配 -0.020	3M 0.000000	1Y 買気配 +0.030
1M 売気配 -0.020		

## <2月27日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	203,845	+5,037
有担保	26,772	-904
無担保	177,073	+5,941

## <2月28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	0.003	-0.006	± 0					-0.100	± 0
トムネ			-0.002	± 0					-0.109	-0.006
スポネ										
1週間物	-0.004	0.001	-0.002	+0.001					-0.099	± 0
2週間物									-0.099	+0.001
3週間物									-0.100	+0.002
1ヶ月物			0.005	+0.006					-0.100	± 0
3ヶ月物			0.110						-0.059	+0.003
6ヶ月物									-0.036	+0.001
1年物									0.012	+0.001

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