

東京短資デイリーレポート

2024/3/5

<3月4日のマナリーベース>

6,564,700

<3月5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	5,342,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,304,700
日銀当座預金残高増減前日比	+37,400

<3月5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	+700
財政等要因	-2,000
資金過不足	-1,300
金融調節	
国債買入	期落 新規
CP等買入	-400
国債補充供給	+31,000 -29,200
金融調節合計	+8,800
当座預金増減-②	+7,500

<3月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,312,200
準備預金残高	4,664,600
積み終了先	4,663,600
超過準備	4,663,600
非準備先残高	647,600

<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)	3,100
残り要積立額(平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	65.5
進捗率乖離幅	+34.4

<3月6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	-24,600
資金過不足	-24,200
金融調節確定分	
国庫短期証券買入	期落 新規
共通担保(全店)	-7,100 +8,300
CP等買入	-300
社債等買入	-200
国債補充供給	+29,200
金融調節合計	+30,900
当座預金増減	+6,700

<3月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残531兆8,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.010%~-0.002% での合いが中心か。

<3月6日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,363,900	+51,700
+40,000	5,358,900	+46,700
+35,000	5,353,900	+41,700
+30,000	5,348,900	+36,700
+25,000	5,343,900	+31,700
+20,000	5,338,900	+26,700
+15,000	5,333,900	+21,700
+10,000	5,328,900	+16,700
+5,000	5,323,900	+11,700
±0	5,318,900	+6,700
-5,000	5,313,900	+1,700
-10,000	5,308,900	-3,300
-15,000	5,303,900	-8,300
-20,000	5,298,900	-13,300
-25,000	5,293,900	-18,300
-30,000	5,288,900	-23,300
-35,000	5,283,900	-28,300
-40,000	5,278,900	-33,300
-45,000	5,273,900	-38,300

<3月5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) 国庫短期証券買入	24/ 3/ 6	1,000億	応札 3,424億 落札 1,002億	最低 +0.026% 平均 +0.026% 按分 62.4%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 3/ 7-24/ 3/14		応札 0ml 落札 0ml	貸付 5.580%
(11:50) 国債補充供給	24/ 3/ 5-24/ 3/ 6		応札 29,484億 落札 29,484億	全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 3/ 6-24/ 3/19		応札 8,345億 落札 8,345億	貸付 0.000%
(13:50) 国債補充供給	24/ 3/ 5-24/ 3/ 6		応札 0億 落札 0億	

<3月5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		
9,8,343	7,509	成長基盤強化支援資金供給	1,001		
2/21~ 3/ 6 7,122.	2/29(5-10Y) 4,752.	33,473	807,139	5/17~ 5/17 0.	
(3/ 6~ 3/19 8,345.)	2/29(10-25Y) 1,504.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	3/18~ 3/18 41,458.	8/19~ 8/19 381.	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/29(25Y-) 753.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.	
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/29(物国) 600.	12/ 2~12/ 2 1,712.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.	
1/10~ 1/10 20,011.	3/ 5(-1Y) 1,501.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	12/15~12/13 54,701.	5/12~ 5/12 181.	
1/13~ 1/14 20,008.	3/ 5(1-3Y) 3,752.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.	
1/16~ 1/16 20,009.	3/ 5(10-25Y) 1,503.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.	
1/19~ 1/20 1,163.	3/ 5(25Y-) 753.	12/ 1~12/ 1 2,464.		2/16~ 2/16 0.	
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.			
			※直近約1年分の期落ち分を記載		
			米ドル資金供給オペ		
			0百万ドル		
			2/29~ 3/ 7 0.		
			(3/ 7~ 3/14 0.)		
			※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		
			16,370百万ドル		
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.		気候変動対応支援資金供給
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.		81,666
			12/ 4~12/ 4 3,325.		7/21~ 7/19 34,398.
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.		1/30~ 1/30 47,268.
			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)		
			0		
			国債売現先オペ		
			0		
			(3/ 6 1,002.)		
			※直近約1週間の実施分を記載		
			国債買入額(固定利回)(月初来)		
			0		
			国債補充供給		
			29,484		
			3/ 5~ 3/ 6 29,484.		
			3/ 5~ 3/ 6 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		
			C P買入額(月初来)		
			0		
			社債買入額(月初来)		
			0		
			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。		
			差引き	980,631	

<3月5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	+0.080000	3M	買気配	0.000
1W 売気配	-0.020	2M	-----	6M	買気配	0.000
2W 売気配	-0.020	3M	-----	1Y	買気配	+0.050
1M 売気配	-0.020					

<3月4日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高		増減
	有担保	無担保	
市場合計	202,000	28,069	-1,910
有担保			+718
無担保	173,931		-2,628

<3月5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	-0.007	-0.001				-----	-0.098	±0
トムネ			-0.004	-0.002				-----	-0.102	±0
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.005	-0.001	-0.003	-0.002				-----	-0.100	±0
2週間物			-0.001	-0.001				-----	-0.103	-0.001
3週間物				-----				-----	-0.103	±0
1ヶ月物				-----				-----	-0.102	±0
3ヶ月物				-----				-----	-0.047	+0.005
6ヶ月物				-----				-----	-0.028	+0.001
1年物				-----				-----	0.016	+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、お問い合わせ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