

東京短資デイリーレポート

2024/3/12

<3月11日のマネタリーベース>

6,568,700

<3月12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	5,351,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,310,800
日銀当座預金残高増減前日比	+40,400

<3月12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		+100
財政等要因		+2,500
資金過不足		+2,600
金融調節		
CP等買入	期落	新規
		+4,000
国債補完供給	+34,000	-33,800
金融調節合計		+4,200
当座預金増減-②		+6,800

<3月12日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,317,600
準備預金残高	4,647,000
積み終了先	4,646,900
超過準備	4,646,900
非準備先残高	670,600

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,772,700
今積み期間所要準備額(平均)	130,100
残り要積立額(積数)	200
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	89.7
進捗率乖離幅	+10.2

<3月13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		+600
財政等要因		-23,900
資金過不足		-23,300
金融調節確定分		
国庫短期証券買入	期落	新規
		+1,000
社債等買入		-100
国債補完供給	+33,800	
金融調節合計		+34,700
当座預金増減		+11,400

<3月13日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残532兆9,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<3月13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	5,374,000	+56,400
+40,000	5,369,000	+51,400
+35,000	5,364,000	+46,400
+30,000	5,359,000	+41,400
+25,000	5,354,000	+36,400
+20,000	5,349,000	+31,400
+15,000	5,344,000	+26,400
+10,000	5,339,000	+21,400
+5,000	5,334,000	+16,400
±0	5,329,000	+11,400
-5,000	5,324,000	+6,400
-10,000	5,319,000	+1,400
-15,000	5,314,000	-3,600
-20,000	5,309,000	-8,600
-25,000	5,304,000	-13,600
-30,000	5,299,000	-18,600
-35,000	5,294,000	-23,600
-40,000	5,289,000	-28,600
-45,000	5,284,000	-33,600

<3月12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/ 3/13	1,000億	応札 6,204億	落札 1,001億	最低 +0.032%	平均 +0.054%	按分 15.4%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 3/14-24/ 3/22		応札 0ml	落札 0ml		貸付 5.580%	
(11:50) 国債補完供給	24/ 3/12-24/ 3/13		応札 34,005億	落札 34,005億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 3/12-24/ 3/13		応札 200億	落札 200億	全取 -0.350%	平均 -0.353%	

<3月12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	
99,566	20,276	成長基盤強化支援資金供給	1,001	
3/ 6~ 3/19 8,345.	3/ 5(-1Y) 1,501.	33,473	807,139	5/17~ 5/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	3/ 5(1-3Y) 3,752.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	3/18~ 3/18 41,458.	8/19~ 8/19 381.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	3/ 5(10-25Y) 1,503.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.
1/10~ 1/10 20,011.	3/ 5(25Y-) 753.	12/ 2~12/ 2 1,712.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.
1/13~ 1/14 20,008.	3/11(1-3Y) 3,755.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	12/15~12/13 54,701.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.	3/11(3-5Y) 4,256.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	3/11(5-10Y) 4,756.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.	米ドル資金供給オペ	2/16~ 2/16 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	0百万ドル	
			3/ 7~ 3/14 0.	
			(3/14~ 3/22 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.	
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.	
			12/ 4~12/ 4 3,325.	
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
			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	1,002
			0	3/ 6 1,002.
				(3/13 1,001.)
				※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
			0	
			国債補完供給	
			34,205	
			3/12~ 3/13 34,005.	
			3/12~ 3/13 200.	
			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
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
				<3月12日 日銀信用概算(除く買切)>
				共通担保(全)固定 99,566 CP等買入(推定) 28,600
				共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 60,800
				国債買現先 0
				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 28,711 手形売切 0
				貸出増加支援 730,359 国債売現先 0
				供給オペ合計 1,011,338 国債補完供給 34,205
				貸出(推定) 0 国売現(米ドル担保) 0
				供給額合計 1,011,338 吸収額合計 34,205
				差し引き 977,133

※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。

<3月12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			-----	3M 買気配 -0.050		
1W 売気配 -0.020		2M +0.100000		6M 買気配 +0.020		
2W 売気配 -0.020		3M +0.150000		1Y 買気配 +0.020		
1M 売気配 -0.020						

<3月11日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	215,387	-378
有担保	28,569	-1,419
無担保	186,818	+1,041

<3月12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	-0.011	-0.001					-0.104	-0.005
トムネ				-----					-0.115	-0.009
スポネ				-----						
1週間物				-----					-0.099	-0.001
2週間物				-----					-0.093	+0.001
3週間物			0.020	-----					-0.086	+0.002
1ヶ月物				-----					-0.077	+0.005
3ヶ月物				-----					-0.014	+0.007
6ヶ月物				-----					0.021	+0.003
1年物				-----					0.042	+0.007

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