

東京短資デイリーレポート

2024/3/18

<3月15日のマナタリーベース>

6,566,200

<3月18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	5,418,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,309,600
日銀当座預金残高増減前日比	+109,300

<3月18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	+300
財政等要因	+18,700
資金過不足	+19,000
金融調節	
国債買入	期落 新規 +13,400
社債等買入	-100
国債補充供給	+32,100 -34,400
貸出増加支援	-45,900 +98,500
金融調節合計	+63,600
当座預金増減-②	+82,600

<3月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,392,200
準備預金残高	4,713,900
積み終了先	4,696,400
超過準備	4,655,400
非準備先残高	678,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,047,500
今積み期間所要準備額 (平均)	130,600
残り要積立額 (積数)	68,800
残り要積立額 (平均)	2,500
準備進捗率(%)	98.3
日数進捗率(%)	9.7
進捗率乖離幅	+88.6

<3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	-600
財政等要因	+6,200
資金過不足	+5,600
金融調節確定分	
国債買現先	期落 新規 +28,500
共通担保(全店)	-8,300 +23,500
社債等買入	-100
国債補充供給	+34,400
金融調節合計	+78,000
当座預金増減	+83,600

<3月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆5,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.010%~-0.001% での合いが中心か。

<3月19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	5,520,800	+128,600
+40,000	5,515,800	+123,600
+35,000	5,510,800	+118,600
+30,000	5,505,800	+113,600
+25,000	5,500,800	+108,600
+20,000	5,495,800	+103,600
+15,000	5,490,800	+98,600
+10,000	5,485,800	+93,600
+5,000	5,480,800	+88,600
±0	5,475,800	+83,600
-5,000	5,470,800	+78,600
-10,000	5,465,800	+73,600
-15,000	5,460,800	+68,600
-20,000	5,455,800	+63,600
-25,000	5,450,800	+58,600
-30,000	5,445,800	+53,600
-35,000	5,440,800	+48,600
-40,000	5,435,800	+43,600
-45,000	5,430,800	+38,600

<3月18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。

(11:50) 国債補充供給	24/ 3/18-24/ 3/19	応札 34,955億 落札 34,955億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:00) 共通担保(全)国	24/ 3/19-24/ 4/ 3	応札 23,469億 落札 23,469億 貸付 0.000%
(13:50) 国債補充供給	24/ 3/18-24/ 3/19	応札 0億 落札 0億
(9:30) 国債買現先	24/ 3/19-24/ 3/21	30,000億 応札 34,000億 落札 30,004億 最低 -0.100% 平均 -0.098% 按分 85.7%

<3月18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)	貸出増加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	33,789	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
		16,370百万ドル	1,001	
3/ 6~ 3/19 8,345.	3/11(1-3Y) 3,755.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	5/17~ 5/17 0.
(3/19~ 4/ 3 23,469.)	3/11(3-5Y) 4,256.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	8/19~ 8/19 381.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	3/11(5-10Y) 4,756.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	11/18~11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	3/18(1-3Y) 3,752.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	3/18(3-5Y) 4,252.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.	3/18(5-10Y) 4,755.	12/ 1~12/ 1 2,464.	3/14~ 3/22 0.	8/18~ 8/18 0.
1/16~ 1/16 20,009.	3/18(25Y-) 754.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	※直近約1年分の期落ち分を記載	11/17~11/17 0.
1/19~ 1/20 1,163.			米ドル資金供給オペ	2/16~ 2/16 0.
			0百万ドル	
			※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	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			3/12 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(3/21 1,000.)	
			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	
			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.	
			国債補充供給	
			34,955	
			3/18~ 3/19 0.	
			国債買現先	
			0	
			(3/19~ 3/21 30,004.)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国債売現先オペ	
			2,003	
			3/ 6 1,002.	
			3/13 1,001.	
			CP買入額(月初来)	