

<8月19日のマネタリーベース>

6,738,700

<8月20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	5,518,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,494,900
日銀当座預金残高増減前日比	+23,900

<8月20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	+500	
財政等要因	+1,800	
資金過不足	+2,300	
金融調節		
国債補完供給	+18,000	-18,700
金融調節合計	-700	
当座預金増減-②		+1,600

<8月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,496,500
準備預金残高	4,932,800
積み終了先	4,927,700
超過準備	4,927,600
非準備先残高	563,700

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,070,500
今積み期間所要準備額(平均)	131,300
残り要積立額(積数)	17,800
残り要積立額(平均)	700
準備進捗率(%)	99.5
日数進捗率(%)	16.1
進捗率乖離幅	+83.4

<8月21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	-15,300	
資金過不足	-15,400	
金融調節確定分		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
社債等買入		+500
国債補完供給	+18,700	
金融調節合計		+19,200
当座預金増減		+3,800

<8月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆8,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228% での合いが中心か。

<8月21日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,545,300	+48,800
+40,000	5,540,300	+43,800
+35,000	5,535,300	+38,800
+30,000	5,530,300	+33,800
+25,000	5,525,300	+28,800
+20,000	5,520,300	+23,800
+15,000	5,515,300	+18,800
+10,000	5,510,300	+13,800
+5,000	5,505,300	+8,800
± 0	5,500,300	+3,800
-5,000	5,495,300	-1,200
-10,000	5,490,300	-6,200
-15,000	5,485,300	-11,200
-20,000	5,480,300	-16,200
-25,000	5,475,300	-21,200
-30,000	5,470,300	-26,200
-35,000	5,465,300	-31,200
-40,000	5,460,300	-36,200
-45,000	5,455,300	-41,200

<8月20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。

(10:40) 米ドル資金供給	24/ 8/22-24/ 8/29	応札 0ml 落札 0ml	貸付 5.580%
(11:50) 国債補完供給	24/ 8/20-24/ 8/21	応札 17,801億 落札 17,801億	全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 8/21-24/ 9/ 4	8,000億 応札 8,877億 落札 8,006億	貸付 0.250% 按分 90.2%
(13:50) 国債補完供給	24/ 8/20-24/ 8/21	応札 1,299億 落札 1,299億	全取 -0.050% 平均 -0.050%

<8月20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
9 9, 2 2 5	3 1, 2 8 9	成長基盤強化支援資金供給 貸出増加支援資金供給	8 9 9
8/ 7~ 8/21 8,004. (8/21~ 9/ 4 8,006.)	8/16(1-3Y) 3,505. 8/16(5-10Y) 4,006. 8/16(10-25Y) 1,509. 8/16(25Y-) 751.	3 1, 5 2 3 8 6 8, 6 5 8	11/18-11/18 93. 2/17~ 2/17 346. 5/17~ 5/12 0. 5/12~ 5/12 181. 8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/17-11/17 0. 2/16~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016. 1/ 6~ 1/ 6 20,014. 1/10~ 1/10 20,011. 1/13~ 1/14 20,008. 1/16~ 1/16 20,009. 1/19~ 1/20 1,163.		9/ 2~ 9/ 2 1,804. 12/ 2~12/ 2 1,712. 3/ 3~ 3/ 3 6,793. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 12/ 1~12/ 1 2,464. 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 6/ 3~ 6/ 3 3,160.	※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 8/15~ 8/22 0. (8/22~ 8/29 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 1 6, 1 2 2 百万ドル 9/ 5~ 9/ 5 5,382. 12/ 4~12/ 4 3,325. 3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 3~ 6/ 3 5,318.	※直近約1年分の期落ち分を記載 気候変動対応支援資金供給 1 1 9, 6 2 9 1/30~ 1/30 47,268. 7/19~ 7/18 72,361.
共通担保(全店)金利入札 7 0, 0 3 5 1/24~ 1/24 10,003. 2/ 1~ 2/ 1 10,004. 2/15~ 2/15 10,004. 3/ 1~ 3/ 1 10,010. 9/15~ 9/15 10,005. 10/10~10/10 10,006. 10/25~10/25 10,003.		国債買入現先オペ 0 国債売現先(米ドルオペ用担保) 0 国庫短期証券買入額(月初末) 0 国債売現先オペ 0	
国債補完供給 1 9, 1 0 0 8/20~ 8/21 17,801. 8/20~ 8/21 1,299.		CP買入額(月初末) 0	
ETF買入額 3 5 6, 9 2 1 約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援) 1 4, 6 2 8 約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額 6, 8 2 3 約定 22/ 6/14 12.		社債買入額(月初末) 0 (8/21 500.)	

<8月20日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,225	CP等買入(推定)	19,100
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	56,900
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	899		
気候変動対応支援	119,626		
成長基盤支援	27,076	手形売切	0
貸出増加支援	790,646	国債売現先	0
供給オペ合計	1,107,507	国債補完供給	19,100
貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
供給額合計	1,107,507	吸収額合計	19,100
	差し引き		1,088,407

※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。

<8月20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 売気配 +0.200	1M +0.300000	3M 買気配 +0.150	
1W 売気配 +0.200	2M +0.280000	6M 買気配 +0.150	
2W 売気配 +0.200	3M買気配 +0.375000	1Y 買気配 +0.250	
1M 売気配 +0.200			

<8月19日のコール市場残高(単位:億円)>		
	残高	増減
市場合計	111,564	+2,053
有担保	36,899	-821
無担保	74,665	+2,874

<8月20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	0.220	0.228	0.227	± 0					0.242	+0.018
トムネ				-----					0.240	+0.017
スポネ				-----						
1週間物			0.227	-0.017					0.190	+0.002
2週間物				-----					0.188	+0.002
3週間物				-----					0.187	+0.003
1ヶ月物				-----					0.188	+0.003
3ヶ月物			0.350	± 0					0.204	+0.002
6ヶ月物				-----					0.254	+0.001
1年物				-----					0.317	+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