

# 東京短資デイリーレポート

2024/8/23

## <8月22日のマネタリーベース>

6,750,400
-----------

## <8月23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	5,515,200	
前日の日銀当座預金残高-①	5,506,700	
日銀当座預金残高増減前日比	+8,500	

## <8月23日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		金融調節	
銀行券要因	-600	CP等買入	-800
財政等要因	+200	社債等買入	-100
資金過不足	-400	国債補完供給	+15,200
		金融調節合計	-1,000
		当座預金増減-②	-1,400

## <8月23日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,505,300
準備預金残高	4,929,000
積み終了先	4,927,900
超過準備	4,927,800
非準備先残高	576,300

## <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)	6,500
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	32.3
進捗率乖離幅	+67.5

## <8月26日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		金融調節確定分	
銀行券要因	+100	CP等買入	-100
財政等要因	+7,100	国債補完供給	+15,300
資金過不足	+7,200	金融調節合計	+15,200
		当座預金増減	+22,400

## <8月26日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残552兆7,700億円)で無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228%での出合いが中心か。
---

## <8月26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	5,572,700	+67,400
+40,000	5,567,700	+62,400
+35,000	5,562,700	+57,400
+30,000	5,557,700	+52,400
+25,000	5,552,700	+47,400
+20,000	5,547,700	+42,400
+15,000	5,542,700	+37,400
+10,000	5,537,700	+32,400
+5,000	5,532,700	+27,400
±0	5,527,700	+22,400
-5,000	5,522,700	+17,400
-10,000	5,517,700	+12,400
-15,000	5,512,700	+7,400
-20,000	5,507,700	+2,400
-25,000	5,502,700	-2,600
-30,000	5,497,700	-7,600
-35,000	5,492,700	-12,600
-40,000	5,487,700	-17,600
-45,000	5,482,700	-22,600

## <8月23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) 国債補完供給	24/ 8/23-24/ 8/26	応札 15,599億 落札 15,599億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/ 8/23-24/ 8/26	応札 0億 落札 0億

## <8月23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
9,9,2,2,7	4,2,5,6,2	成長基盤強化支援資金供給	8,9,9
8/21~ 9/ 4 8,006.	8/16(1-3Y) 3,505.	3 1,5 2 3	8 6 8, 6 5 8
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	8/16(5-10Y) 4,006.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	8/16(10-25Y) 1,509.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/10~ 1/10 20,011.	8/16(25Y-) 751.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/13~ 1/14 20,008.	8/22(1-3Y) 3,509.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.
1/16~ 1/16 20,009.	8/22(3-5Y) 3,758.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.
1/19~ 1/20 1,163.	8/22(5-10Y) 4,006.	12/ 1~12/ 1 2,464.	12/ 1~12/ 1 2,464.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	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
			8/22~ 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.
			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(月初末)
			0
			国債売現先オペ
			0
			※直近約1週間の実施分を記載
			国債買入額(固定利回)(月初末)
			0
			国債補完供給
			1,5,5,9,9
			8/23~ 8/26 15,599.
			8/23~ 8/26 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.
			※直近約1週間の実施分を記載
			共通担保(全)固定
			99,227
			CP等買入(推定)
			17,900
			共通担保(全)金入
			70,035
			社債等買入(推定)
			57,300
			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
			手形売出
			0
			貸出増加支援
			790,646
			国債売現先
			0
			供給オペ合計
			1,107,509
			国債補完供給
			15,599
			貸出(推定)
			0
			国売現(米ドル担保)
			0
			供給額合計
			1,107,509
			吸収額合計
			15,599
			差し引き
			1,091,910

※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23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	-----	3M	買気配 +0.150
1W	売気配 +0.200	2M	-----	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.200				

## <8月22日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	113,587	-586
有担保	37,631	+190
無担保	75,956	-776

## <8月23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	0.215	0.228	0.227	±0				-----	0.142	-0.090
トムネ				-----				-----	0.227	-0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.268	-0.122				-----	0.193	-0.003
2週間物			0.300	-----				-----	0.193	±0
3週間物				-----				-----	0.191	±0
1ヶ月物				-----				-----	0.191	±0
3ヶ月物	0.290		0.328	+0.005				-----	0.203	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.253	-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