

東京短資デイリーレポート

2024/8/28

<8月27日のマネタリーベース>

6,747,700

<8月28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	5,512,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,503,400
日銀当座預金残高増減前日比	+9,000

<8月28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		-6,600
資金過不足		-6,700
金融調節		
国債補充供給	+16,200	-15,700
金融調節合計		+500
当座預金増減-②		-6,200

<8月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,497,200
準備預金残高	4,937,000
積み終了先	4,935,900
超過準備	4,935,900
非準備先残高	560,200

<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)	2,800
残り要積立額 (平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+58.0

<8月29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		-200
財政等要因		-2,400
資金過不足		-2,600
金融調節確定分		
国債買入		+10,400
CP等買入		-200
国債補充供給	+15,700	
金融調節合計		+25,900
当座預金増減		+23,300

<8月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残552兆500億円)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29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	5,565,500	+68,300
+40,000	5,560,500	+63,300
+35,000	5,555,500	+58,300
+30,000	5,550,500	+53,300
+25,000	5,545,500	+48,300
+20,000	5,540,500	+43,300
+15,000	5,535,500	+38,300
+10,000	5,530,500	+33,300
+5,000	5,525,500	+28,300
± 0	5,520,500	+23,300
-5,000	5,515,500	+18,300
-10,000	5,510,500	+13,300
-15,000	5,505,500	+8,300
-20,000	5,500,500	+3,300
-25,000	5,495,500	-1,700
-30,000	5,490,500	-6,700
-35,000	5,485,500	-11,700
-40,000	5,480,500	-16,700
-45,000	5,475,500	-21,700

<8月28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) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 8/29	3,750億	応札 9,064億	落札 3,755億	最低 +0.006%	平均 +0.006%	按分 89.9%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 8/29	4,000億	応札 11,550億	落札 4,008億	最低 +0.013%	平均 +0.014%	按分 50.3%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 8/29	1,500億	応札 3,982億	落札 1,503億	最低 +0.016%	平均 +0.016%	按分 95.9%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/ 8/29	750億	応札 2,218億	落札 752億	最低 +0.015%	平均 +0.017%	按分 67.1%
(10:10) 国債買入(物国)	24/ 8/29	600億	応札 2,535億	落札 600億	按分 -0.380円	平均 -0.413円	按分 72.7%
(11:50) 国債補充供給	24/ 8/28-24/ 8/29		応札 16,013億	落札 16,013億	全取 -0.050%	平均 -0.050%	
(13:50) 国債補充供給	24/ 8/28-24/ 8/29		応札 0億	落札 0億			
(9:30) 成長基盤(米ドル特別)	24/ 9/ 5-25/ 9/ 5	1,661ml					先数 17先

<8月28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	貸出増加支援資金供給		
8/21~ 9/ 4 8,006.	8/22(1-3Y) 3,509.	3 1, 5 2 3	8 6 8, 6 5 8	11/18-11/18 93.	
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	8/22(3-5Y) 3,758.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	8/22(5-10Y) 4,006.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15-12/13 54,701.	5/17~ 5/12 0.	
1/10~ 1/10 20,011.	(8/29(3-5Y) 3,755.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.	
1/13~ 1/14 20,008.	(8/29(5-10Y) 4,008.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	8/19~ 8/18 279.	
1/16~ 1/16 20,009.	(8/29(10-25Y) 1,503.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		8/18~ 8/18 0.	
1/19~ 1/20 1,163.	(8/29(25Y-) 752.)	12/ 1~12/ 1 2,464.		11/17-11/17 0.	
	(8/29(物国) 600.)	3/ 2~ 3/ 2 7,922.		2/16~ 2/16 0.	
		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.		
			(8/29~ 9/ 5 1.)		
			※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.		
			(9/ 5~ 9/ 5 1,661.)		
			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		
			国債補充供給		
			1 6, 0 1 3		
			8/28~ 8/29 16,013.		
			8/28~ 8/29 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		
			C P買入額(月初末)		
			0		
			(8/30 4,000.)		
			社債買入額(月初末)		
			5 0 0		
			8/21 500.		
			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	国債補充供給 16,013
			貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保) 0
			供給額合計	1,107,509	吸収額合計 16,013
			差し引き	1,091,496	

※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28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	+0.285000	3M	買気配 +0.120
1W	売気配 +0.200	2M	+0.289000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	+0.372000	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.200				

<8月27日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,504	+1,395
有担保	38,178	-1,633
無担保	77,326	+3,028

<8月28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	0.229	0.227	± 0					0.243	+0.001
トムネ				-----					0.196	-0.025
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.182	-0.011
2週間物			0.310	-0.008					0.184	-0.009
3週間物			0.275	-----					0.186	-0.005
1ヶ月物				-----					0.186	-0.003
3ヶ月物			0.350	-----					0.203	± 0
6ヶ月物				-----					0.253	± 0
1年物				-----					0.316	± 0

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