

東京短資デイリーレポート

2024/8/30

<8月29日のマネタリーベース>

6,743,300

<8月30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	5,518,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,498,600
日銀当座預金残高増減前日比	+19,500

<8月30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	+400		
財政等要因	+2,100		
資金過不足	+2,500		
金融調節			
CP等買入	-700	新規	+4,000
社債等買入	-100		
国債補完供給	+16,100		-16,000
金融調節合計			+3,300
当座預金増減-②			+5,800

<8月30日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,504,400
準備預金残高	4,911,400
積み終了先	4,911,300
超過準備	4,911,100
非準備先残高	593,000

<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)	800
残り要積立額 (平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	54.8
進捗率乖離幅	+45.1

<9月2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	-16,900		
資金過不足	-16,300		
金融調節確定分			
社債等買入	-300	期落	新規
国債補完供給	+16,000		
成長基盤強化支援	-1,500		
金融調節合計			+14,200
当座預金増減			-2,100

<9月2日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残550兆2,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228% での合いが中心か。

<9月2日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,547,300	+42,900
+40,000	5,542,300	+37,900
+35,000	5,537,300	+32,900
+30,000	5,532,300	+27,900
+25,000	5,527,300	+22,900
+20,000	5,522,300	+17,900
+15,000	5,517,300	+12,900
+10,000	5,512,300	+7,900
+5,000	5,507,300	+2,900
± 0	5,502,300	-2,100
-5,000	5,497,300	-7,100
-10,000	5,492,300	-12,100
-15,000	5,487,300	-17,100
-20,000	5,482,300	-22,100
-25,000	5,477,300	-27,100
-30,000	5,472,300	-32,100
-35,000	5,467,300	-37,100
-40,000	5,462,300	-42,100
-45,000	5,457,300	-47,100

<8月30日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 8/30-24/ 9/ 2	応札 16,167億 落札 16,167億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 8/30-24/ 9/ 2	応札 201億 落札 201億 全取 -0.150% 平均 -0.150%

<8月30日 各オペ残高と内訳>

共通担保(全店)固定金利		国債買入額(月初来)		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		被災地金融機関支援資金供給		
9,9,2,2,7	5,3,1,8,0	16,1,2,2	百万ドル	9,5	9,5	5,382	12,4	12,4	3,325	
8/21~ 9/ 4	8,006	8/29(3-5Y)	3,755	9/ 2~ 9/ 2	1,804	9/16~ 9/13	132,310	2/17~ 2/17	346	
1/ 6~ 1/ 6	20,014	8/29(5-10Y)	4,008	12/ 2~12/ 2	1,712	12/15~12/13	54,701	5/17~ 5/12	0	
1/ 5~ 1/ 6	10,016	8/29(10-25Y)	1,503	3/ 3~ 3/ 3	6,793	3/17~ 3/17	64,498	5/12~ 5/12	181	
1/10~ 1/10	20,011	8/29(25Y-)	752	6/ 2~ 6/ 2	2,644	6/18~ 6/18	26,498	8/19~ 8/18	279	
1/13~ 1/14	20,008	8/29(物国)	600	9/ 1~ 9/ 1	5,024			8/18~ 8/18	0	
1/16~ 1/16	20,009			12/ 1~12/ 1	2,464	※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			3/ 2~ 3/ 2	7,922	米ドル資金供給オペ		2/16~ 2/16	0	
				6/ 3~ 6/ 3	3,160	1百万ドル				
						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				
						16,122百万ドル				
						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		
						国債売現先オペ		0		
						0				
						※直近約1週間の実施分を記載				
						国債買入額(固定利回)(月初来)		0		
						国債補完供給		16,368		
						8/30~ 9/ 2		16,167		
						8/30~ 9/ 2		201		
						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				
						C/P買入額(月初来)		4,000		
						8/30		4,000		
						社債買入額(月初来)		500		
						8/21		500		
						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。				
						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	16,368
						貸出(推定)		0	国債現(米ドル担保)	0
						供給額合計		1,107,509	吸収額合計	16,368
						差し引き		1,091,141		

<8月30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	+0.260000	3M	買気配 +0.120
1W	売気配 +0.200	2M	+0.280000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.150
1M	売気配 +0.200				

<8月29日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	117,428	+2,398
有担保	37,548	-907
無担保	79,880	+3,305

<8月30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	0.218	0.229	0.227	-0.001					0.173	-0.031
トムネ				-----					0.230	+0.172
スポネ				-----						
1週間物			0.390	-----					0.187	+0.024
2週間物	0.300	0.400	0.320	-----					0.187	+0.017
3週間物				-----					0.185	+0.011
1ヶ月物				-----					0.185	+0.012
3ヶ月物				-----					0.201	± 0
6ヶ月物				-----					0.252	± 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