

東京短資デイリーレポート

2024/9/3

<9月2日のマナリーベース>

6,725,600

<9月3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	5,473,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,481,900
日銀当座預金残高増減前日比	-8,700

<9月3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	+700
財政等要因	-30,400
資金過不足	-29,700
金融調節	
CP等買入	-100
社債等買入	-200
国債補完供給	+15,200
金融調節合計	-1,600
当座預金増減-②	-31,300

<9月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,450,600
準備預金残高	4,878,000
積み終了先	4,877,900
超過準備	4,877,900
非準備先残高	572,600

<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)	700
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	61.3
進捗率乖離幅	+38.6

<9月4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	-25,200
資金過不足	-25,000
金融調節確定分	
共通担保(全店)	-8,000
国債補完供給	+16,500
金融調節合計	+16,500
当座預金増減	-8,500

<9月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残544兆2,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228% での合いが中心か。

<9月4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	5,487,100	+36,500
+40,000	5,482,100	+31,500
+35,000	5,477,100	+26,500
+30,000	5,472,100	+21,500
+25,000	5,467,100	+16,500
+20,000	5,462,100	+11,500
+15,000	5,457,100	+6,500
+10,000	5,452,100	+1,500
+5,000	5,447,100	-3,500
±0	5,442,100	-8,500
-5,000	5,437,100	-13,500
-10,000	5,432,100	-18,500
-15,000	5,427,100	-23,500
-20,000	5,422,100	-28,500
-25,000	5,417,100	-33,500
-30,000	5,412,100	-38,500
-35,000	5,407,100	-43,500
-40,000	5,402,100	-48,500
-45,000	5,397,100	-53,500

<9月3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/ 9/ 5-24/ 9/12	応札	1ml 落札	1ml	貸付	5.580%
(11:50) 国債補完供給	24/ 9/ 3-24/ 9/ 4	応札	16,827億	落札	16,827億	全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 9/ 4-24/ 9/18	8,000億	応札	11,806億	落札	8,004億 貸付 0.250% 按分 67.8%
(13:50) 国債補完供給	24/ 9/ 3-24/ 9/ 4	応札	0億	落札	0億	
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	24/ 9/ 4-24/ 9/13	5,000億	応札	2億	落札	2億 全取 +0.220% 平均 +0.220%

<9月3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)	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
9,227	0	29,719	868,658	899
8/21~ 9/ 4 8,006. (9/ 4~ 9/18 8,004.)	8/29(3-5Y) 3,755. 8/29(5-10Y) 4,008.	12/ 2-12/ 2 1,712. 3/ 3~ 3/ 3 6,793.	9/16~ 9/13 132,310. 12/15-12/13 54,701.	11/18-11/18 93. 2/17~ 2/17 346.
1/ 5~ 1/ 6 10,016. 1/ 6~ 1/ 6 20,014.	8/29(10-25Y) 1,503. 8/29(25Y-) 752.	6/ 2~ 6/ 2 2,644. 9/ 1~ 9/ 1 5,024.	3/17~ 3/17 64,498. 6/18~ 6/18 26,498.	5/17~ 5/12 0. 5/12~ 5/12 181.
1/10~ 1/10 20,011. 1/13~ 1/14 20,008.	8/29(物国) 600.	12/ 1-12/ 1 2,464. 3/ 2~ 3/ 2 7,922.	6/18~ 6/18 26,498.	8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0.
1/16~ 1/16 20,009. 1/19~ 1/20 1,163.		6/ 3~ 6/ 3 3,160. 9/ 5~ 9/ 5 5,382.	11/17-11/17 0. 2/16~ 2/16 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 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.) 国債買入先オペ 0 C P買入額(月初末) 0 社債買入額(月初末) 0	※直近約1年分の期落ち分を記載 米ドル資金供給オペ 1百万ドル 8/29~ 9/ 5 1. (9/ 5~ 9/12 1.) 国債売現先(米ドルオペ用担保) 0 (9/ 4~ 9/13 2.) 国庫短期証券買入額(月初末) 0 国債売現先オペ 0	気候変動対応支援資金供給 119,629 1/30~ 1/30 47,268. 7/19~ 7/18 72,361.
	※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 16,827				
9/ 3~ 9/ 4 16,827. 9/ 3~ 9/ 4 0.				
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.				

※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。

<9月3日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	NCD/CP現先	CPプライマリー	TBアウトライト
S/N	売気配 +0.200	1M +0.249000	3M 買気配 +0.120
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		

<9月2日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,775	-2,877
有担保	37,819	+801
無担保	77,956	-3,678

<9月3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					0.240	-0.004
トムネ				-----					0.237	+0.004
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.191	+0.004
2週間物				-----					0.189	+0.002
3週間物				-----					0.187	+0.001
1ヶ月物			0.320	-----					0.184	±0
3ヶ月物				-----					0.201	±0
6ヶ月物				-----					0.253	±0
1年物				-----					0.318	±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