

東京短資デイリーレポート

2024/9/5

<9月4日のマナリーベース>

6,666,200

<9月5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	5,447,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,423,300
日銀当座預金残高増減前日比	+24,100

<9月5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		+200
財政等要因		+2,200
資金過不足		+2,400
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+8,700
CP等買入	-100	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+16,100	-15,800
金融調節合計		+8,800
当座預金増減-②		+11,200

<9月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,434,500
準備預金残高	4,868,300
積み終了先	4,868,200
超過準備	4,868,200
非準備先残高	566,200

<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)	500
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率 (%)	99.9
日数進捗率 (%)	67.7
進捗率乖離幅	+32.2

<9月6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		+300
財政等要因		-6,800
資金過不足		-6,500
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+15,800	
金融調節合計		+15,600
当座預金増減		+9,100

<9月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残544兆3,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228% での合いが中心か。

<9月6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	5,488,600	+54,100
+40,000	5,483,600	+49,100
+35,000	5,478,600	+44,100
+30,000	5,473,600	+39,100
+25,000	5,468,600	+34,100
+20,000	5,463,600	+29,100
+15,000	5,458,600	+24,100
+10,000	5,453,600	+19,100
+5,000	5,448,600	+14,100
± 0	5,443,600	+9,100
-5,000	5,438,600	+4,100
-10,000	5,433,600	-900
-15,000	5,428,600	-5,900
-20,000	5,423,600	-10,900
-25,000	5,418,600	-15,900
-30,000	5,413,600	-20,900
-35,000	5,408,600	-25,900
-40,000	5,403,600	-30,900
-45,000	5,398,600	-35,900

<9月5日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 9/ 5-24/ 9/ 6	応札 16,154億 落札 16,154億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/ 9/ 5-24/ 9/ 6	応札 0億 落札 0億

<9月5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/ 2 2 5	8, 7 5 9	9/ 2 2 5	8, 7 5 9	12/ 2-12/ 2	1, 712.	9/16~ 9/13	132,310.	2/17~ 2/17	346.
9/ 4~ 9/18	8,004.	8/29(3-5Y)	3,755.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	12/15~12/13	54,701.	5/17~ 5/12	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	8/29(5-10Y)	4,008.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.	3/17~ 3/17	64,498.	5/12~ 5/12	181.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	8/29(10-25Y)	1,503.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.	6/18~ 6/18	26,498.	8/19~ 8/18	279.
1/10~ 1/10	20,011.	8/29(25Y-)	752.	12/ 1~12/ 1	2,464.			8/18~ 8/18	0.
1/13~ 1/14	20,008.	8/29(物国)	600.	3/ 2~ 3/ 2	7,922.	※直近約1年分の期落ち分を記載		11/17~11/17	0.
1/16~ 1/16	20,009.	9/ 5(-1Y)	1,501.	6/ 3~ 6/ 3	3,160.	米ドル資金供給オペ		2/16~ 2/16	0.
1/19~ 1/20	1,163.	9/ 5(1-3Y)	3,501.	12/ 4~12/ 4	3,325.	1百万ドル			
		9/ 5(3-5Y)	3,757.	※直近約1年分の期落ち分を記載		9/ 5~ 9/12		1.	
				成長基盤強化支援米ドル特別					
				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			
				国債売先オペ(米ドルオペ用担保)		2			
				9/ 4~ 9/13		2.			
				国債売先オペ		0			
				C P買入額(月初末)		0			
				社債買入額(月初末)		0			
				J-REIT買入額		6,823			
				約定 22/ 6/14		12.			
				ETF買入額		356,921			
				約定 23/10/ 4		701.			
				約定 21/ 3/31		12.			
				約定 23/10/ 4		701.			
				約定 21/ 3/31		12.			
				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5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	1M	-----	3M	買気配
1W	+0.200	2M	+0.300000	6M	+0.150
2W	+0.200	3M	-----	1Y	+0.280
1M	+0.200				

<9月4日のコール市場残高(単位:億円)>

残高			増減		
市場合計	113,295	-3,949	有担保	38,130	-1,355
			無担保	75,165	-2,594

<9月5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	0.213	0.228	0.227	± 0					0.246	+0.003
トムネ				-----					0.239	+0.002
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.193	+0.002
2週間物				-----					0.193	+0.003
3週間物				-----					0.192	+0.003
1ヶ月物			0.325	-0.048					0.192	+0.008
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