

東京短資デイリーレポート

2024/9/6

<9月5日のマナリーベース>

6,677,100

<9月6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	5,443,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,434,500
日銀当座預金残高増減前日比	+9,100

<9月6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	+300
財政等要因	-9,400
資金過不足	-9,100
金融調節	
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	+900
当座預金増減-②	-8,200

<9月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,426,300
準備預金残高	4,862,600
積み終了先	4,862,500
超過準備	4,862,500
非準備先残高	563,700

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,071,500
今積み期間所要準備額(平均)	131,300
残り要積立額(積数)	200
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	77.4
進捗率乖離幅	+22.5

<9月9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	+8,600
資金過不足	+9,200
金融調節確定分	
国債買入	+6,200
CP等買入	-100
社債等買入	-300
国債補完供給	+14,700
金融調節合計	+20,500
当座預金増減	+29,700

<9月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残545兆6,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228% での合いが中心か。

<9月9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	5,501,000	+74,700
+40,000	5,496,000	+69,700
+35,000	5,491,000	+64,700
+30,000	5,486,000	+59,700
+25,000	5,481,000	+54,700
+20,000	5,476,000	+49,700
+15,000	5,471,000	+44,700
+10,000	5,466,000	+39,700
+5,000	5,461,000	+34,700
±0	5,456,000	+29,700
-5,000	5,451,000	+24,700
-10,000	5,446,000	+19,700
-15,000	5,441,000	+14,700
-20,000	5,436,000	+9,700
-25,000	5,431,000	+4,700
-30,000	5,426,000	-300
-35,000	5,421,000	-5,300
-40,000	5,416,000	-10,300
-45,000	5,411,000	-15,300

<9月6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(5Y-10Y)	24/ 9/ 9	4,000億	応札 8,341億	落札 4,006億	最低 +0.002%	平均 +0.004%	按分 10.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 9/ 9	1,500億	応札 2,461億	落札 1,504億	最低 +0.005%	平均 +0.008%	按分 99.2%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/ 9/ 9	750億	応札 1,611億	落札 753億	最低 +0.003%	平均 +0.005%	按分 11.9%
(11:50) 国債補完供給	24/ 9/ 6-24/ 9/ 9		応札 15,005億	落札 15,005億	全取 -0.050%	平均 -0.050%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 9/ 6-24/ 9/ 9		応札 0億	落札 0億			

<9月6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/ 2 2 5	8, 7 5 9	2 9, 7 1 9	8 6 8, 6 5 8	8 9 9
9/ 4~ 9/18 8,004.	9/ 5(-1Y) 1,501.	12/ 2-12/ 2 1,712.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18-11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/ 5(1-3Y) 3,501.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	12/15-12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/ 5(3-5Y) 3,757.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.	(9/ 9(5-10Y) 4,006.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.	(9/ 9(10-25Y) 1,504.)	12/ 1~12/ 1 2,464.	9/ 5~ 9/12 1.	8/19~ 8/18 279.
1/16~ 1/16 20,009.	(9/ 9(25Y-) 753.)	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	米ドル資金供給オペ	8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	1百万ドル	11/17-11/17 0.
		12/ 4~12/ 4 3,325.	9/ 5~ 9/12 1.	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	
			1 2, 4 0 1百万ドル	
			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)	
			2	
			9/ 4~ 9/13 2.	
			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, 0 0 5	
			9/ 6~ 9/ 9 15,005.	
			9/ 6~ 9/ 9 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	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			<9月6日 日銀信用概算(除く買切)>	
			共通担保(全)固定 99,225	CP等買入(推定) 20,400
			共通担保(全)金入 70,035	社債等買入(推定) 56,500
			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 25,272	手形売切 0
			貸出増加支援 790,646	国債売現先 0
			供給オペ合計 1,105,703	国債補完供給 15,005
			貸出(推定) 0	国債売現先(米ドル担保) 2
			供給額合計 1,105,703	吸収額合計 15,007
			差し引き 1,090,696	

※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6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	+0.305000	3M	買気配
1W	+0.200	2M	-----	6M	+0.150
2W	+0.200	3M	-----	1Y	+0.280
1M	+0.200				

<9月5日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	116,807	+3,512
有担保	40,247	+2,117
無担保	76,560	+1,395

<9月6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					0.243	-0.003
トムネ				-----					0.241	+0.002
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.198	+0.005
2週間物				-----					0.198	+0.005
3週間物				-----					0.196	+0.004
1ヶ月物	0.300	0.330	0.320	-0.005					0.194	+0.002
3ヶ月物				-----					0.203	+0.002
6ヶ月物				-----					0.254	+0.001
1年物				-----					0.319	+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、ETF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