

# 東京短資デイリーレポート

2023/2/24

## <2月22日のマナタリーベース>

6,503,100
-----------

## <2月24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	5,301,100	
前日の日銀当座預金残高-①	5,234,600	
日銀当座預金残高増減前日比	+66,500	

## <2月24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		-500
財政等要因		+8,000
資金過不足		+7,500
金融調節		
国債買入	期落	新規
		+5,500
CP等買入		-400
社債等買入		-200
国債補完供給		+54,500
金融調節合計		-200
当座預金増減-②		+7,300

## <2月24日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,241,900
準備預金残高	4,586,900
積み終了先	4,585,500
超過準備	4,585,100
非準備先残高	655,000

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,518,100
今積み期間所要準備額 (平均)	125,600
残り要積立額 (積数)	7,300
残り要積立額 (平均)	400
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	39.3
進捗率乖離幅	+60.4

## <2月27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		-400
財政等要因		-2,100
資金過不足		-2,500
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
		-800
国債補完供給		+59,600
金融調節合計		+58,800
当座預金増減		+56,300

## <2月27日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残529兆8,200億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。
---

## <2月27日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,343,200	+101,300
+40,000	5,338,200	+96,300
+35,000	5,333,200	+91,300
+30,000	5,328,200	+86,300
+25,000	5,323,200	+81,300
+20,000	5,318,200	+76,300
+15,000	5,313,200	+71,300
+10,000	5,308,200	+66,300
+5,000	5,303,200	+61,300
± 0	5,298,200	+56,300
-5,000	5,293,200	+51,300
-10,000	5,288,200	+46,300
-15,000	5,283,200	+41,300
-20,000	5,278,200	+36,300
-25,000	5,273,200	+31,300
-30,000	5,268,200	+26,300
-35,000	5,263,200	+21,300
-40,000	5,258,200	+16,300
-45,000	5,253,200	+11,300

## <2月24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(国)(5Y-10Y)	23/ 2/27	応札	0億 落札	0億	固定利回較差	0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 2/27	応札	0億 落札	0億	固定利回較差	+0.050%
(11:50) 国債補完供給	23/ 2/24-23/ 2/27	応札	60,227億 落札	60,227億	全取	-0.350% 平均 -0.354%
(13:50) 国債補完供給	23/ 2/24-23/ 2/27	応札	0億 落札	0億		
( 9:30) 成長基盤(米ドル特則)	23/ 3/ 3-24/ 3/ 4	1,022mil			先数	11先
( 9:30) 成長基盤(米ドル特則)	23/ 3/ 3-24/ 3/ 4	1,093mil			先数	10先
( 9:30) 成長基盤(米ドル特則)	23/ 3/ 3-24/ 3/ 4	38mil			先数	11先

## <2月24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 5,511	7 2,347	成長基盤強化支援資金供給	1,716
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/21(1-3Y) 4,257.	5 5,060	6 82,240
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/21(3-5Y) 5,006.	3/ 4~ 3/ 3 2,859.	3/18~ 3/17 37,714.
1/10~ 1/10 20,011.	2/21(5-10Y) 6,764.	3/ 6~ 3/ 6 1.	6/19~ 6/19 28,033.
1/13~ 1/14 20,008.	2/21(25Y-) 1,505.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	9/17~ 9/15 13,014.
1/16~ 1/16 20,009.	2/24(5-10Y) 3,004.	6/ 5~ 6/ 5 5.	12/16~12/15 20,601.
1/19~ 1/20 1,163.	2/24(10-25Y) 1,004.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	※直近約1年分の期落ち分を記載
2/22~ 3/ 8 4,290.		9/ 4~ 9/ 4 34.	米ドル資金供給オペ
		12/ 4~12/ 4 10,258.	3 百万ドル
		3/ 4~ 3/ 4 2,178.	2/24~ 3/ 2 3.
			※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則
			1 7,925百万ドル
			3/ 4~ 3/ 3 2,369.
			6/ 3~ 6/ 2 5,848.
			9/ 2~ 9/ 5 6,101.
			12/ 2~12/ 4 3,607.
			(3/ 3~ 3/ 4 2,153.)
			国債買入先オペ
			0
			新型コロナ企業金融支援
			9 8,393
			8/31~ 2/28 11,713.
			9/28~ 3/31 73,020.
			11/30~ 2/28 2,788.
			12/23~ 3/31 8,358.
			1/27~ 4/27 2,514.
			気候変動対応支援資金供給
			4 4,214
			7/21~ 7/21 15,953.
			1/30~ 1/30 28,261.
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			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)
			5 3,54
			国庫短期証券買入額(月初末)
			4,000
			2/ 1 1,000.
			2/20(5-10Y) 428.
			2/ 8 1,000.
			2/21(5-10Y) 538.
			2/15 1,000.
			2/22(5-10Y) 1,495.
			2/22 1,000.
			2/24(5-10Y) 1,413.
			ETF買入額
			3 54,818
			約定 22/12/ 2 701.
			ETF買入額(企業支援)
			1 4,628
			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
			CP買入額(月初末)
			3,965
			2/13 3,965.
			(2/28 3,980.)
			社債買入額(月初末)
			1,000
			2/21 1,000.

## <2月24日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	CP等買入(推定)	26,300
国債買入先	0	82,100
被災地金融機関支援	1,716	
気候変動対応支援	44,214	
成長基盤強化支援	50,442	
貸出増加支援	608,567	手形売出 0
新型コロナ企業金融支援	98,393	国債売現先 0
供給オペ合計	898,843	国債補完供給 60,227
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保) 0
供給額合計	898,843	吸収額合計 60,227
	差し引き	838,616

※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。

## <2月24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アウトライイト	
S/N	0.000	1M	+0.010000	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	+0.015000	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	+0.045000	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

## <2月22日のコール市場残高(単位:億円)>

		残高	増減
市場合計		193,158	-3,549
有担保		29,046	-2,781
無担保		164,112	-768

## <2月24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	-0.060	0.001	-0.009	-0.001				-----	-0.081	-0.002
トムネ			-0.010	-0.001				-----	-0.084	-0.002
スポネ			-0.005	-----				-----		
1週間物			-0.010	+0.011				-----	-0.098	-0.002
2週間物	-0.015	-0.007	-0.014	+0.014				-----	-0.106	± 0
3週間物				-----				-----	-0.116	+0.001
1ヶ月物	-0.006	0.180	0.002	+0.009				-----	-0.132	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	-0.145	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	-0.105	± 0
1年物				-----				-----	-0.084	± 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