

東京短資デイリーレポート

2024/2/20

<2月19日のマネタリーベース>

6,622,300

<2月20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	5,396,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,363,800
日銀当座預金残高増減前日比	+33,100

<2月20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		-4,400
資金過不足		-4,900
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-100	
国債補充供給	+36,600	-35,000
金融調節合計		+1,400
当座預金増減-②		-3,500

<2月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,360,300
準備預金残高	4,685,500
積み終了先	4,677,400
超過準備	4,676,300
非準備先残高	674,800

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,772,800
今積み期間所要準備額 (平均)	130,100
残り要積立額 (積数)	31,900
残り要積立額 (平均)	1,300
準備進捗率(%)	99.1
日数進捗率(%)	17.2
進捗率乖離幅	+81.9

<2月21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		-18,000
資金過不足		-18,300
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-7,500	+7,100
CP等買入	-500	
社債等買入		+1,000
国債補充供給	+35,000	
金融調節合計		+36,100
当座預金増減		+17,800

<2月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残537兆8,100億円)で 無担保コール0/Nは-0.005%~-0.001% での合いが中心か。

<2月21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	5,423,100	+62,800
+40,000	5,418,100	+57,800
+35,000	5,413,100	+52,800
+30,000	5,408,100	+47,800
+25,000	5,403,100	+42,800
+20,000	5,398,100	+37,800
+15,000	5,393,100	+32,800
+10,000	5,388,100	+27,800
+5,000	5,383,100	+22,800
±0	5,378,100	+17,800
-5,000	5,373,100	+12,800
-10,000	5,368,100	+7,800
-15,000	5,363,100	+2,800
-20,000	5,358,100	-2,200
-25,000	5,353,100	-7,200
-30,000	5,348,100	-12,200
-35,000	5,343,100	-17,200
-40,000	5,338,100	-22,200
-45,000	5,333,100	-27,200

<2月20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) 国庫短期証券買入	24/ 2/21	1,000億	応札 6,255億	落札 1,000億	最低 +0.027%	平均 +0.047%	按分 71.0%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 2/22-24/ 2/29		応札 8ml	落札 8ml	貸付 5.580%		
(11:50) 国債補充供給	24/ 2/20-24/ 2/21		応札 35,291億	落札 35,291億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 2/21-24/ 3/ 6		応札 7,122億	落札 7,122億	貸付 0.000%		
(13:50) 国債補充供給	24/ 2/20-24/ 2/21		応札 28億	落札 28億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(14:45) ミドルオペ用担保供給	24/ 2/21-24/ 3/ 1	5,000億	応札 2億	落札 2億	全取 -0.100%	平均 -0.100%	

<2月20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)	貸出支援基金の運用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
98,693	38,815	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
2/ 7~ 2/21 7,472.	2/16(1-3Y) 3,754.	35,651	807,139
(2/21~ 3/ 6 7,122.)	2/16(3-5Y) 4,256.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/16(10-25Y) 1,503.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/16(25Y-) 755.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/10~ 1/10 20,011.		12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/13~ 1/14 20,008.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	
1/16~ 1/16 20,009.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	
1/19~ 1/20 1,163.		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	
		12/ 1~12/ 1 2,464.	
			※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
			2/15~ 2/22 1.
			(2/22~ 2/29 8.)
			※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
			16,426百万ドル
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.
			12/ 4~12/ 4 3,325.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			0
			(2/21~ 3/ 1 2.)
			国庫短期証券買入額(月初末)
			国債売現先オペ
			2,000
			0
			2/ 7 1,000.
			2/14 1,000.
			(2/21 1,000.)
			CP買入額(月初末)
			3,999
			2/14 3,999.
			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

※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20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 0.000	1M +0.080000	3M 買気配 -0.100
1W 売気配 -0.020	2M +0.040000	6M 買気配 -0.080
2W 売気配 -0.020	3M +0.059000	1Y 買気配 +0.030
1M 売気配 -0.020		

<2月19日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	202,584	-11,395
有担保	29,160	-950
無担保	173,424	-10,445

<2月20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	-0.087	0.001	-0.006	±0					-0.095	-0.003
トムネ			-0.003	±0					-0.099	-0.008
スポネ			-0.002	-----						
1週間物	-0.015	-0.001	-0.009	-----					-0.098	-0.006
2週間物	-0.001	0.005	0.001	+0.001					-0.098	-0.004
3週間物			0.001	-----					-0.100	-0.004
1ヶ月物				-----					-0.104	-0.005
3ヶ月物			0.030	-----					-0.075	+0.012
6ヶ月物				-----					-0.059	+0.008
1年物				-----					-0.004	+0.025

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