

東京短資デイリーレポート

2024/2/21

<2月20日のマネタリーベース>

6,619,300

<2月21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	5,378,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,360,300
日銀当座預金残高増減前日比	+17,800

<2月21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		-400
財政等要因		-20,800
資金過不足		-21,200
金融調節		
	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
国債補完供給	+35,000	-33,100
金融調節合計		+3,000
当座預金増減-②		-18,200

<2月21日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,342,100
準備預金残高	4,664,000
積み終了先	4,659,800
超過準備	4,658,800
非準備先残高	678,100

<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)	26,700
残り要積立額(平均)	1,200
準備進捗率(%)	99.2
日数進捗率(%)	20.7
進捗率乖離幅	+78.5

<2月22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		-1,000
財政等要因		+22,800
資金過不足		+21,800
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+12,800
CP等買入	-700	
社債等買入	-200	
国債補完供給	+33,100	
金融調節合計		+45,000
当座預金増減		+66,800

<2月22日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残540兆8,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.005%~-0.001% での合いが中心か。

<2月22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	5,453,900	+111,800
+40,000	5,448,900	+106,800
+35,000	5,443,900	+101,800
+30,000	5,438,900	+96,800
+25,000	5,433,900	+91,800
+20,000	5,428,900	+86,800
+15,000	5,423,900	+81,800
+10,000	5,418,900	+76,800
+5,000	5,413,900	+71,800
±0	5,408,900	+66,800
-5,000	5,403,900	+61,800
-10,000	5,398,900	+56,800
-15,000	5,393,900	+51,800
-20,000	5,388,900	+46,800
-25,000	5,383,900	+41,800
-30,000	5,378,900	+36,800
-35,000	5,373,900	+31,800
-40,000	5,368,900	+26,800
-45,000	5,363,900	+21,800

<2月21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(1Y-3Y)	24/ 2/22	3,750億 応札 12,110億 落札 3,756億	最低 +0.002% 平均 +0.004% 按分 21.0%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 2/22	4,250億 応札 10,823億 落札 4,260億	最低 +0.004% 平均 +0.005% 按分 74.2%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 2/22	4,750億 応札 7,104億 落札 4,754億	最低 -0.003% 平均 +0.001% 按分 2.8%
(11:50) 国債補完供給	24/ 2/21-24/ 2/22	応札 33,445億 落札 33,445億	全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	24/ 2/21-24/ 2/22	応札 0億 落札 0億	

<2月21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	98,343	国債買入額(月初末)	38,815	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	
	7,035		3,754	成長基盤強化支援資金供給	1,001	
2/21~ 3/ 6	7,122.	2/16(1-3Y)	3,754.	35,651	807,139	
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	2/16(3-5Y)	4,256.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	2/16(10-25Y)	1,503.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	
1/10~ 1/10	20,011.	2/16(25Y-)	755.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	
1/13~ 1/14	20,008.	(2/22(1-3Y)	3,756.)	12/ 2~12/ 2	1,712.	
1/16~ 1/16	20,009.	(2/22(3-5Y)	4,260.)	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	
1/19~ 1/20	1,163.	(2/22(5-10Y)	4,754.)	6/ 2~ 6/ 2	2,644.	
				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	
					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)	
					2	
					2/21~ 3/ 1	2.
					国庫短期証券買入額(月初末)	
					3,000	
					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.
					社債買入額(月初末)	
					1,000	
					2/21	1,000.
					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21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	-----
		2M	-----
1W	売気配 -0.020	3M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	6M	買気配 -0.040
1M	売気配 -0.020	3M	+0.150000
		1Y	買気配 +0.040

<2月20日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	209,040	+6,456
有担保	30,101	+941
無担保	178,939	+5,515

<2月21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	-0.085	0.001	-0.006	±0					-0.095	±0
トムネ			-0.002	+0.001					-0.105	-0.006
スポネ										
1週間物	-0.040	0.001	-0.017	-0.008					-0.102	-0.004
2週間物	-0.003	0.000	-0.002	-0.003					-0.104	-0.006
3週間物			0.040	+0.039					-0.105	-0.005
1ヶ月物									-0.108	-0.004
3ヶ月物			0.030	±0					-0.073	+0.002
6ヶ月物									-0.051	+0.008
1年物									0.008	+0.012

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