

東京短資デイリーレポート

2024/2/5

<2月2日のマナリーベース>

6,565,500

<2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	5,349,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,302,800
日銀当座預金残高増減前日比	+46,700

<2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		+900
財政等要因		-1,500
資金過不足		-600
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+14,600
国債買現先		+49,900
CP等買入		-100
国債補完供給	+33,300	-36,400
金融調節合計		+61,300
当座預金増減-②		+60,700

<2月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,363,500
準備預金残高	4,679,700
積み終了先	4,679,200
超過準備	4,678,700
非準備先残高	683,800

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,040,400
今積み期間所要準備額 (平均)	130,300
残り要積立額 (積数)	3,300
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率 (%)	99.9
日数進捗率 (%)	67.7
進捗率乖離幅	+32.2

<2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		+700
財政等要因		-5,400
資金過不足		-4,700
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買現先	-49,900	+29,600
国債補完供給	+36,400	
金融調節合計		+16,100
当座預金増減		+11,400

<2月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残537兆4,900億円)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	5,419,900	+56,400
+40,000	5,414,900	+51,400
+35,000	5,409,900	+46,400
+30,000	5,404,900	+41,400
+25,000	5,399,900	+36,400
+20,000	5,394,900	+31,400
+15,000	5,389,900	+26,400
+10,000	5,384,900	+21,400
+5,000	5,379,900	+16,400
± 0	5,374,900	+11,400
-5,000	5,369,900	+6,400
-10,000	5,364,900	+1,400
-15,000	5,359,900	-3,600
-20,000	5,354,900	-8,600
-25,000	5,349,900	-13,600
-30,000	5,344,900	-18,600
-35,000	5,339,900	-23,600
-40,000	5,334,900	-28,600
-45,000	5,329,900	-33,600

<2月5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。

(11:50) 国債補完供給	24/ 2/ 5-24/ 2/ 6	応札 36,567億 落札 36,567億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	24/ 2/ 5-24/ 2/ 6	応札 0億 落札 0億
(9:20) 国債買現先	24/ 2/ 5-24/ 2/ 6 50,000億	応札 49,736億 落札 49,736億 全取 -0.100% 平均 -0.099%
(9:30) 国債買現先	24/ 2/ 6-24/ 2/ 16 40,000億	応札 31,100億 落札 31,100億 全取 -0.100% 平均 -0.093%

<2月5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		
99,673	14,270	成長基盤強化支援資金供給	1,001		
1/23~ 2/ 7 8,452.	1/30(3-5Y) 4,254.	35,651	807,139	2/18~ 2/16 0.	
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	1/30(5-10Y) 4,760.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	1/30(25Y-) 753.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.	
1/10~ 1/10 20,011.	1/30(物国) 602.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.	
1/13~ 1/14 20,008.	2/ 5(-1Y) 1,500.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.	
1/16~ 1/16 20,009.	2/ 5(1-3Y) 3,759.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.	
1/19~ 1/20 1,163.	2/ 5(3-5Y) 4,256.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.	
	2/ 5(5-10Y) 4,755.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.	
		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		
			3百万ドル		
			2/ 1~ 2/ 8 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		
			49,736		
			2/ 5~ 2/ 6 49,736.		
			(2/ 6~ 2/16 31,100.)		
			1/31~ 2/ 9 2.		
			国債売現先オペ(米ドルオペ用担保)		
			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		
			36,567		
			2/ 5~ 2/ 6 36,567.		
			2/ 5~ 2/ 6 0.		
			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		
			C P買入額(月初末)		
			0		
			社債買入額(月初末)		
			0		
			国債買現先		
			49,736		
			被災地金融機関支援		
			1,001		
			気候変動対応支援		
			81,666		
			成長基盤支援		
			30,589	手形売出 0	
			貸出増加支援	730,665	国債売現先 0
			供給オペ合計	1,063,365	国債補完供給 36,567
			貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保) 2
			供給額合計	1,063,365	吸収額合計 36,569
			差し引き	1,026,796	

※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5日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	1M	3M	1M	3M	1Y	3M
0.000	1M	3M	1M	3M	1Y	3M
1W 売気配 -0.020	2M	6M	1M	3M	1Y	3M
2W 売気配 -0.020	3M	1Y	1M	3M	1Y	3M
1M 売気配 -0.020			1M	3M	1Y	3M

<2月2日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高		増減
	有担保	無担保	
市場合計	187,308	31,937	+796
有担保	155,371	31,937	+1,858
無担保	31,937	0	-1,062

<2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	-0.087	0.001	-0.008	± 0					-0.068	+0.002
トムネ			-0.005	± 0					-0.083	-0.012
スポネ										
1週間物			-0.010	+0.010					-0.088	-0.007
2週間物	-0.008	-0.001	-0.005	-0.018					-0.092	-0.004
3週間物									-0.098	-0.002
1ヶ月物	-0.013	0.001	-0.005	-0.005					-0.104	-0.001
3ヶ月物									-0.125	-0.002
6ヶ月物									-0.091	+0.002
1年物									-0.053	+0.004

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