

東京短資デイリーレポート

2024/2/13

<2月9日のマナリーベース>

6,613,100

<2月13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	5,389,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,353,700
日銀当座預金残高増減前日比	+36,100

<2月13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	+200
財政等要因	-32,100
資金過不足	-31,900
金融調節	
国債買現先	期落 新規
	+29,800
CP等買入	-500
国債補完供給	+33,400 -35,800
金融調節合計	+26,900
当座預金増減-②	-5,000

<2月13日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,348,700
準備預金残高	4,675,500
積み終了先	4,675,500
超過準備	4,675,400
非準備先残高	673,200

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,044,000
今積み期間所要準備額(平均)	130,500
残り要積立額(積数)	0
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	93.5
進捗率乖離幅	+6.5

<2月14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	+200
財政等要因	-1,900
資金過不足	-1,700
金融調節確定分	
国庫短期証券買入	期落 新規
	+1,000
国債買現先	-29,800
CP等買入	-100 +4,000
国債補完供給	+35,800
金融調節合計	+10,900
当座預金増減	+9,200

<2月14日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残535兆7,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.013%~-0.003% での合いが中心か。

<2月14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	5,402,900	+54,200
+40,000	5,397,900	+49,200
+35,000	5,392,900	+44,200
+30,000	5,387,900	+39,200
+25,000	5,382,900	+34,200
+20,000	5,377,900	+29,200
+15,000	5,372,900	+24,200
+10,000	5,367,900	+19,200
+5,000	5,362,900	+14,200
±0	5,357,900	+9,200
-5,000	5,352,900	+4,200
-10,000	5,347,900	-800
-15,000	5,342,900	-5,800
-20,000	5,337,900	-10,800
-25,000	5,332,900	-15,800
-30,000	5,327,900	-20,800
-35,000	5,322,900	-25,800
-40,000	5,317,900	-30,800
-45,000	5,312,900	-35,800

<2月13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	24/ 2/14	1,000億	応札 5,831億	落札 1,000億	最低 +0.023%	平均 +0.024%	按分 33.0%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 2/15-24/ 2/22		応札 1ml	落札 1ml		貸付 5.580%	
(11:50) 国債補完供給	24/ 2/13-24/ 2/14		応札 36,158億	落札 36,158億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 2/13-24/ 2/14		応札 0億	落札 0億			

<2月13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(月初来)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
98,693	28,547	35,651	807,139	1,001
2/ 7~ 2/21 7,472.	2/ 9(1-3Y) 3,755.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/ 9(3-5Y) 4,255.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/ 9(5-10Y) 4,758.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.	2/ 9(10-25Y) 1,509.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.		2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.		5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		8/18~ 8/18 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.		11/17~11/17 0.
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			4百万ドル	
			2/ 8~ 2/15 4.	
			(2/15~ 2/22 1.)	
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			成長基盤強化支援ドル特別	
			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	
			61,105	
			2/13~ 2/14 30,005.	
			2/ 6~ 2/16 31,100.	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			2	
			2/ 7~ 2/16 2.	
			国庫短期証券買入額(月初来)	
			1,000	
			0	
			2/ 7 1,000.	
			(2/14 1,000.)	
			国債売現先オペ	
			0	
			2/ 7 1,000.	
			(2/14 1,000.)	
			C P買入額(月初来)	
			0	
			(2/14 3,999.)	
			社債買入額(月初来)	
			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	

※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13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 -0.090
1W	売気配 -0.020	2M	+0.025000	6M	買気配 -0.090
2W	売気配 -0.020	3M	+0.100000	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

<2月9日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	184,279	-14,048
有担保	30,125	+629
無担保	154,154	-14,677

<2月13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	-0.086	0.001	-0.005	±0					-0.070	+0.004
トムネ			-0.003	-0.001					-0.062	-0.009
スポネ										
1週間物			-0.001	+0.011					-0.072	+0.003
2週間物			-0.002						-0.080	+0.003
3週間物									-0.086	+0.002
1ヶ月物									-0.091	+0.005
3ヶ月物			0.030	-0.010					-0.104	+0.008
6ヶ月物									-0.079	+0.003
1年物									-0.045	+0.003

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