東京短資デイリーレポート

2024/8/14

<u><8月13日のマネタリーベース></u>

6,670,500

<8月14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	高 5,447,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,424,800
日銀当座預金残高増減前日上	上 +22,200

<8月14日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

Γ	1	資金需給実績			
		銀行券要因			+500
		財政等要因			-1,600
		資金過不足			-1,100
	- 3	金融調節			
			期	落	新規
		CP等胃 入		-200	

	CP等買入		-200	
	国債補完供給	+20	,800	-18,300
	金融調節合計			+2,300
	当座預金増減-②			+1,200
Ξ				

<8月14日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,426,000
準備預金残高	4,848,300
積み終了先	4,848,300
超過準備	4,848,200
非準預先残高	577,700

<参考>

ヽ ヲ ¬ ′	
今積み期間所要準備額(積数)	4,075,700
今積み期間所要準備額(平均)	131,500
残り要積立額(積数)	0
残り要積立額(平均)	0
準預進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	96.8
進捗率乖離幅	+3.2
<u> </u>	13.2

<8月15日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

- 0	/J = 2 H = 2 H = 1/E 1/E =	<u>. ~ 🗀 ///// .</u>		
	資金需給予想			
	銀行券要因			+200
ш	財政等要因			+54,700
ш	資金過不足			+54,900
	金融調節確定分			,
		期落		新規
ш	CP等買入		-200	
ш	国債補完供給	+18	,300	
	金融調節合計			+18,100
1 -	当座預金増減			+73,000
	コ圧!決並治院			113,000

<8月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残549兆9,000億円)で
無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228%
での出合いが中心か。

<8月15日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

$\begin{array}{c} +40,000 & 5,539,000 & +113,000 \\ +35,000 & 5,534,000 & +108,000 \\ +30,000 & 5,529,000 & +103,000 \\ +25,000 & 5,524,000 & +98,000 \\ +20,000 & 5,519,000 & +93,000 \\ +15,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ -5,000 & 5,499,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,484,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \end{array}$	8月15日9時20分	のオペによる日	1銀当座預金状況
$\begin{array}{c} +45,000 & 5,544,000 & +118,000 \\ +40,000 & 5,539,000 & +113,000 \\ +35,000 & 5,534,000 & +108,000 \\ +30,000 & 5,529,000 & +103,000 \\ +25,000 & 5,524,000 & +98,000 \\ +20,000 & 5,519,000 & +93,000 \\ +110,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +78,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ \hline \pm & 0 & 5,499,000 & +73,000 \\ -5,000 & 5,494,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,489,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \\ \end{array}$	9時20分の	日銀当座	前日比
$\begin{array}{c} +40,000 & 5,539,000 & +113,000 \\ +35,000 & 5,534,000 & +108,000 \\ +30,000 & 5,529,000 & +103,000 \\ +25,000 & 5,524,000 & +98,000 \\ +20,000 & 5,519,000 & +93,000 \\ +15,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ -5,000 & 5,499,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,484,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \end{array}$	オペ	預金残高	増減
$\begin{array}{c} +35,000 & 5,534,000 & +108,000 \\ +30,000 & 5,529,000 & +103,000 \\ +25,000 & 5,524,000 & +98,000 \\ +20,000 & 5,519,000 & +93,000 \\ +15,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ \pm 0 & 5,499,000 & +73,000 \\ -5,000 & 5,494,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +53,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,479,000 & +48,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \\ \end{array}$	+45,000	5,544,000	+118,000
$\begin{array}{c} +30,000 & 5,529,000 & +103,000 \\ +25,000 & 5,524,000 & +98,000 \\ +20,000 & 5,519,000 & +93,000 \\ +15,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ \pm & 0 & 5,499,000 & +73,000 \\ -5,000 & 5,494,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,484,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \\ \end{array}$	+40,000	5,539,000	+113,000
$\begin{array}{c} +25,000 & 5,524,000 & +98,000 \\ +20,000 & 5,519,000 & +93,000 \\ +15,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ \pm & 0 & 5,499,000 & +73,000 \\ -5,000 & 5,494,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,484,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \\ \end{array}$	+35,000	5,534,000	+108,000
$\begin{array}{c} +20,000 & 5,519,000 & +93,000 \\ +15,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ \pm & 0 & 5,499,000 & +73,000 \\ -5,000 & 5,494,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,484,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \\ \end{array}$	+30,000	5,529,000	+103,000
$\begin{array}{c} +15,000 & 5,514,000 & +88,000 \\ +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ \hline \pm & 0 & 5,499,000 & +73,000 \\ -5,000 & 5,494,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,484,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \end{array}$	+25,000	5,524,000	+98,000
$\begin{array}{c} +10,000 & 5,509,000 & +83,000 \\ +5,000 & 5,504,000 & +78,000 \\ \pm & 0 & 5,499,000 & +73,000 \\ -5,000 & 5,494,000 & +68,000 \\ -10,000 & 5,489,000 & +63,000 \\ -15,000 & 5,484,000 & +58,000 \\ -20,000 & 5,479,000 & +53,000 \\ -25,000 & 5,474,000 & +48,000 \end{array}$	+20,000	5,519,000	+93,000
$\begin{array}{c ccccccccccccccccccccccccccccccccccc$	+15,000	5,514,000	+88,000
$\begin{array}{c ccccccccccccccccccccccccccccccccccc$	+10,000	5,509,000	+83,000
-5,000 5,494,000 +68,000 -10,000 5,489,000 +63,000 -15,000 5,484,000 +58,000 -20,000 5,479,000 +53,000 -25,000 5,474,000 +48,000	+5,000	5,504,000	+78,000
-10,000 5,489,000 +63,000 -15,000 5,484,000 +58,000 -20,000 5,479,000 +53,000 -25,000 5,474,000 +48,000	± 0	5,499,000	+73,000
-15,000 5,484,000 +58,000 -20,000 5,479,000 +53,000 -25,000 5,474,000 +48,000	-5,000	5,494,000	+68,000
-20,000 5,479,000 +53,000 -25,000 5,474,000 +48,000	-10,000	5,489,000	+63,000
-25,000 5,474,000 +48,000	-15,000	5,484,000	+58,000
	-20,000	5,479,000	+53,000
_30 000 5 469 000 +43 000	-25,000	5,474,000	+48,000
-30,000 3,703,000 173,000	-30,000	5,469,000	+43,000
-35,000 5,464,000 +38,000	-35,000	5,464,000	+38,000
-40,000 5,459,000 +33,000	-40,000	5,459,000	+33,000
-45,000 5,454,000 +28,000	-45,000	5,454,000	+28,000

8月14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/ 8/14-24/ 8/15	応札 18,	686億 落札	18,686億 全国	仅 -0.050% 平均	-0.050%
	(13:50) 国債補完供給	24/ 8/14-24/ 8/15	応札	0億 落札	0億		
ı							

<8月14日 各才ペ残高と内訳> (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) 貸出支援基金の運営として行うオペレーション 被災地金融	
□世海坦伊(今庄)田宁今刊[団]信買 ス 貊(日 加亜) 貸甲士樫其今の運営と□ て行う オペリニション 據※據今朝	
	機関支援資金供給
99,225 21,518 成長基盤強化支援資金供給 貸出増加支援資金供給	1,001
8/ 7~ 8/21 8,004. 8/ 8(1-3Y) 3,502. 3 1,5 2 3 8 6 8,6 5 8 8/19~ 8	/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014. 8/ 8(3-5Y) 3,752. 9/ 2~ 9/ 2 1,804. 9/16~ 9/13 132,310. 11/18~11	/18 93.
1/ 5~ 1/ 6	
1/30 1/40 10,010. 0/6(10-251) 1,501. 12/2 12/2 1,112. 12/13 12/13 54,101. 2/17 2 1/10~1/10 20,011. 3/3~3/3 6,793. 3/17~3/17 64,498. 5/17~5	
	,
1/13~ 1/14 20,008. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 6/18~	
1/16~ 1/16 20,009. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 8/18~ 8	
1/19~ 1/20	,
3/2~3/2 7,922. 米ドル資金供給オペ 2/16~2	/16 0.
6/3~6/3 3,160. O百万ドル	
8/ 8~ 8/15 0.	
※直近約1年分の期落ち分を記載 (8/15~8/22 0.)	
成長基盤強化支援米ドル特則	
16,122百万ドル	
	対応支援資金供給
-///	9,629
7 0 , 0 3 5 3/ 4~ 3/ 4 2,097. 1/30~ 1	
	,
1/24~ 1/24 10,003. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 7/19~ 7	/18 72,361.
2/ 1~ 2/ 1 10,004.	
2/15~ 2/15 10,004. 国債買現先オペ	
3/1~3/1 10,010. 0 国債売現先(米ドルオペ用担保)	
9/15~ 9/15 10,005. O	
10/10~10/10 10,006.	
10/25~10/25 10,003.	
国庫短期証券買入額(月初来)	
国債売現先オペの	
※直近約1週間の実施分を記載 0	
国債買入額(固定利回)(月初来)	
0	
国債補完供給	
18,686	
8/14~8/15 18,686. CP買入額(月初来)	
8/14~ 8/15 O. O	
│ 	<u>(買切)></u>
共通担保(全)固定 99,225 CP等買入(
共通担保(全)金入 70,035 社債等買入	(推定) 56,900
ETF買入額 国債買現先 0	
356,921 被災地金融機関支援 1,001	
約定 23/10/ 4 701. 社債買入額(月初来) 気候変動対応支援 119,626	
	5出 0
FTF買入額(企業支援) 0 成長其般支援 27 076 毛形詩	
ETF買入額(企業支援 27,076 手形売	
14,628 貸出増加支援 790,646 国債売	
14,628 約定 21/ 3/31 12. 貸出増加支援 790,646 国債売 供給オペ合計 1,107,609 国債補完	供給 18,686
14,628 約定 21/3/31 12. J-REIT買入額 貸出増加支援 790,646 国債売 供給オペ合計 1,107,609 国債補完 貸出(推定) 貸出(推定) 0 国馬現(米ド	供給 18,686 L担保) 0
14,628 約定 21/ 3/31 12. 貸出増加支援 790,646 国債売 供給オペ合計 1,107,609 国債補完	供給 18,686 LL担保) 0 合計 18,686

※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。

<8月14日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	117HW4 77	יומי יווי	<u> XIIIU </u>	4.01	/			
	NCD/CP現先	C	Pプライマリ	TE	3アウトライト	 <8月13日の	コール市場残高(単位:億円)_
S/N	売気配 +0.200	1M	+0.259000	3M	買気配 +0.150		残高	増減
1W	売気配 +0.200	2M		6M	買気配 +0.150	市場合計	114,804	+243
2W	売気配 +0.200	3M		1Y	買気配 +0.250	有担保	36,907	+313
1M	売気配 +0.200					無担保	77.897	-70

<8月14日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

~0∕214 H	ツコール			- 水ホレベ	ハ・レー	ト(手 灰・					
		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	0.218	0.290	0.228	+0.001					0.224	-0.005	
トムネ									0.230	+0.006	
スポネ											
1週間物	0.228	0.390	0.233	+0.005					0.180	+0.003	
2週間物	0.320	0.330	0.323	-0.007					0.181	+0.005	
3週間物									0.179	+0.002	
1ヶ月物									0.180	+0.001	
3ヶ月物			0.350	-0.250					0.200	± 0	
6ヶ月物									0.252	± 0	
1年物									0.315	-0.002	

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