

東京短資デイリーレポート

2023/7/5

<7月4日のマナリーベース>

6,656,300

<7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	5,403,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,395,100
日銀当座預金残高増減前日比	+8,000

<7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		+200
財政等要因		-32,400
資金過不足		-32,200
金融調節		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-8,900	+6,300
CP等買入	-200	
国債補充供給	+41,300	-41,900
金融調節合計		-2,400
当座預金増減-②		-34,600

<7月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,360,500
準備預金残高	4,694,000
積み終了先	4,693,800
超過準備	4,693,800
非準備先残高	666,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,883,300
今積み期間所要準備額(平均)	129,400
残り要積立額(積数)	1,300
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	66.7
進捗率乖離幅	+33.2

<7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		+2,800
資金過不足		+2,100
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+12,400
国債補充供給	+41,900	
金融調節合計		+54,300
当座預金増減		+56,400

<7月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆6,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.035%~-0.020% での合いが中心か。

<7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	5,461,900	+101,400
+40,000	5,456,900	+96,400
+35,000	5,451,900	+91,400
+30,000	5,446,900	+86,400
+25,000	5,441,900	+81,400
+20,000	5,436,900	+76,400
+15,000	5,431,900	+71,400
+10,000	5,426,900	+66,400
+5,000	5,421,900	+61,400
± 0	5,416,900	+56,400
-5,000	5,411,900	+51,400
-10,000	5,406,900	+46,400
-15,000	5,401,900	+41,400
-20,000	5,396,900	+36,400
-25,000	5,391,900	+31,400
-30,000	5,386,900	+26,400
-35,000	5,381,900	+21,400
-40,000	5,376,900	+16,400
-45,000	5,371,900	+11,400

<7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。

(10:10) 国債買入(-1Y)	23/ 7/ 6	1,500億	応札 6,255億	落札 1,504億	最低 +0.004%	平均 +0.006%	按分 58.8%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	23/ 7/ 6	4,250億	応札 12,439億	落札 4,251億	最低 +0.003%	平均 +0.004%	按分 41.0%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 7/ 6	4,500億	応札 9,962億	落札 4,508億	最低 +0.001%	平均 +0.003%	按分 23.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 7/ 6	2,000億	応札 4,628億	落札 2,004億	最低 -0.007%	平均 -0.004%	按分 21.0%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 7/ 6		応札 0億	落札 0億	固定利回差		+0.105%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 7/ 6		応札 0億	落札 0億	固定利回差		+0.306%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 7/ 7-23/ 7/13		応札 0m1	落札 0m1	貸付		5.330%
(11:50) 国債補充供給	23/ 7/ 5-23/ 7/ 6		応札 41,837億	落札 41,837億	全取		-0.350%
(13:50) 国債補充供給	23/ 7/ 5-23/ 7/ 6		応札 0億	落札 0億			

<7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	97,531	国債買入額(月初末)	13,863	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給	1,001
7/ 5~ 7/19	6,310.	7/ 3(3-5Y)	4,502.	47,883	754,212	8/20~ 8/18	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	7/ 3(5-10Y)	5,754.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	9/17~ 9/15	13,014.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/ 3(10-25Y)	2,001.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.
1/10~ 1/10	20,011.	7/ 3(25Y-)	1,006.	12/ 4~12/ 4	10,258.	3/18~ 3/18	41,458.
1/13~ 1/14	20,008.	7/ 3(物国)	600.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.
1/16~ 1/16	20,009.	(7/ 6(-1Y)	1,504.)	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	6/19~ 6/19	63,179.
1/19~ 1/20	1,163.	(7/ 6(1-3Y)	4,251.)	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	6/29~ 7/ 7	1.
		(7/ 6(3-5Y)	4,508.)	12/ 2~12/ 2	1,712.	(7/ 7~ 7/13	0.)
		(7/ 6(10-25Y)	2,004.)	3/ 3~ 3/ 3	6,793.		
				※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			
				17,427百万ドル			
				9/ 2~ 9/ 5	6,101.		
				12/ 2~12/ 4	3,607.		
				3/ 3~ 3/ 4	2,153.		
				6/ 2~ 6/ 3	5,566.		
				国債買現先オペ			
				0	国債売現先(米ドルオペ用担保)		
					2		
					6/28~ 7/10	2.	
					国庫短期証券買入額(月初末)		
				国債売現先オペ			
				0	1,001		
				※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	7/ 5	1,001.	
				国債補充供給			
				41,837			
				7/ 5~ 7/ 6	41,837.		
				7/ 5~ 7/ 6	0.		
				ETF買入額			
				356,220			
				約定 23/ 3/14	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			
				共通担保(全店)金利入札			
				40,021			
				1/24~ 1/24	10,003.		
				2/ 1~ 2/ 1	10,004.		
				2/15~ 2/15	10,004.		
				3/ 1~ 3/ 1	10,010.		
				CP買入額(月初末)			
				0			
				社債買入額(月初末)			
				0			
				貸出増加支援	683,578	手形売出	0
				新型コロナ企業金融支援	0	国債売現先	0
				供給オペ合計	909,762	国債補充供給	41,837
				貸出(推定)	0	国債売(米ドル担保)	2
				供給額合計	909,762	吸収額合計	41,839
				差し引き	867,923		

※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。

<7月5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 +0.008000	3M 買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M +0.001000	6M 買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020		

<7月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	158,805	-9,473
有担保	29,343	-1,791
無担保	129,462	-7,682

<7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	-0.032	+0.028					-0.074	+0.003
トムネ				-----					-0.077	± 0
スポネ				-----						
1週間物			-0.033	+0.025					-0.088	± 0
2週間物	-0.050	-0.049	-0.050	+0.002					-0.096	+0.001
3週間物				-----					-0.103	+0.003
1ヶ月物	-0.050	-0.030	-0.032	-----					-0.113	± 0
3ヶ月物				-----					-0.130	-0.002
6ヶ月物				-----					-0.131	± 0
1年物				-----					-0.102	± 0

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