

東京短資デイリーレポート

2023/7/18

<7月14日のマネタリーベース>

6,592,900

<7月18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	5,366,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,332,700
日銀当座預金残高増減前日比	+33,800

<7月18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		+12,400
資金過不足		+12,600
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+16,700
国債買現先	-38,100	
CP等買入	-700	
社債等買入	-100	
国債補充供給	+47,900	-47,000
金融調節合計		-21,300
当座預金増減-②		-8,700

<7月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,324,000
準備預金残高	4,635,600
積み終了先	4,618,000
超過準備	4,594,500
非準備先残高	688,400

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,015,900
今積み期間所要準備額 (平均)	129,500
残り要積立額 (積数)	66,100
残り要積立額 (平均)	2,400
準備進捗率(%)	98.3
日数進捗率(%)	9.7
進捗率乖離幅	+88.6

<7月19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		+500
財政等要因		+9,400
資金過不足		+9,900
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-6,300	+9,000
国債補充供給	+47,000	
金融調節合計		+49,700
当座預金増減		+59,600

<7月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残538兆3,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.050%~-0.020% での合いが中心か。

<7月19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	5,428,600	+104,600
+40,000	5,423,600	+99,600
+35,000	5,418,600	+94,600
+30,000	5,413,600	+89,600
+25,000	5,408,600	+84,600
+20,000	5,403,600	+79,600
+15,000	5,398,600	+74,600
+10,000	5,393,600	+69,600
+5,000	5,388,600	+64,600
±0	5,383,600	+59,600
-5,000	5,378,600	+54,600
-10,000	5,373,600	+49,600
-15,000	5,368,600	+44,600
-20,000	5,363,600	+39,600
-25,000	5,358,600	+34,600
-30,000	5,353,600	+29,600
-35,000	5,348,600	+24,600
-40,000	5,343,600	+19,600
-45,000	5,338,600	+14,600

<7月18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(国)(5Y-10Y)	23/ 7/19	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	-0.025%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 7/19	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.175%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 7/20-23/ 7/27	応札	0mil	落札	0mil	貸付	5.330%
(11:50) 国債補充供給	23/ 7/18-23/ 7/19	応札	47,403億	落札	47,403億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:00) 共通担保(全)国	23/ 7/19-23/ 8/ 2	応札	8,970億	落札	8,970億	貸付	0.000%
(13:50) 国債補充供給	23/ 7/18-23/ 7/19	応札	0億	落札	0億		

<7月18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	9 7, 5 3 1	国債買入額(月初末)	5 6, 6 5 1	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	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
7/ 5~ 7/19	6,310.	7/11(1-3Y)	4,252.	4 7, 8 8 3	7 5 4, 2 1 2	8/20~ 8/18	0.
(7/19~ 8/ 2	8,970.)	7/11(5-10Y)	6,755.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	9/17~ 9/15	13,014.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/11(10-25Y)	2,001.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	7/11(25Y-)	1,004.	12/ 4~12/ 4	10,258.	3/18~ 3/18	41,458.
1/10~ 1/10	20,011.	7/18(1-3Y)	4,251.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.
1/13~ 1/14	20,008.	7/18(3-5Y)	4,500.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	※直近約1年分の期落ち分を記載	
1/16~ 1/16	20,009.	7/18(5-10Y)	6,758.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	米ドル資金供給オペ	0百万ドル
1/19~ 1/20	1,163.	7/18(25Y-)	1,000.	12/ 2~12/ 2	1,712.	7/13~ 7/20	0.
				3/ 3~ 3/ 3	6,793.	(7/20~ 7/27	0.)
						※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	
						1 7, 4 2 7 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)	0
						国庫短期証券買入額(月初末)	
						国債売現先オペ	2,002
						7/ 5	1,001.
						7/12	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
						国債補充供給	4 7, 4 0 3
						7/18~ 7/19	47,403.
						7/18~ 7/19	0.
						ETF買入額	3 5 6, 2 2 0
						約定 23/ 3/14	701.
						ETF買入額(企業支援)	1 4, 6 2 8
						約定 21/ 3/31	12.
						J-REIT買入額	6, 8 2 3
						約定 22/ 6/14	12.
						※直近約1週間の実施分を記載	
						CP買入額(月初末)	3, 9 9 6
						7/14	3,996.
						社債買入額(月初末)	0
						7月18日 日銀信用概算(除く買切)	
						共通担保(全)固定	97,531
						共通担保(全)金入	40,021
						国債買現先	0
						被災地金融機関支援	1,001
						気候変動対応支援	44,214
						成長基盤支援	43,417
						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	47,403
						貸出(推定)	0
						国債売現先(米ドル担保)	0
						供給額合計	909,762
						吸収額合計	47,403
						差し引き	862,359

※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18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	-----	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	0.000000	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	0.000000	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

<7月14日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	174,114	-20,805
有担保	32,863	+1,434
無担保	141,251	-22,239

<7月18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	-0.048	-0.027				-----	-0.087	-0.011
トムネ				-----				-----	-0.090	-0.005
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.058	-0.040	-0.051	-0.017				-----	-0.096	-0.005
2週間物	-0.060	-0.010	-0.040	-0.022				-----	-0.103	-0.005
3週間物				-----				-----	-0.109	+0.001
1ヶ月物	-0.055	0.001	-0.046	-0.036				-----	-0.120	-0.002
3ヶ月物				-----				-----	-0.133	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	-0.135	-0.001
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、ETF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