

# 東京短資デイリーレポート

2023/7/25

### <7月24日のマナリーベース>

6,642,800
-----------

### <7月25日9時20分日銀オベ後の状況>

9時20分の日銀オベ	ノーオベ
日銀発表の日銀当座預金残高	5,436,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,383,400
日銀当座預金残高増減前日比	+53,000

### <7月25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	-100
財政等要因	+13,900
資金過不足	+13,800
金融調節	
CP等買入	-100
社債等買入	-400
国債補完供給	+40,900
金融調節合計	+100
当座預金増減-②	+13,900

### <7月25日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,397,300
準備預金残高	4,695,200
積み終了先	4,693,200
超過準備	4,693,100
非準備先残高	702,100

### <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)	22,500
残り要積立額 (平均)	1,100
準備進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	32.3
進捗率乖離幅	+67.1

### <7月26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	-100
財政等要因	-6,500
資金過不足	-6,600
金融調節確定分	
国庫短期証券買入	+1,000
CP等買入	-200
社債等買入	-100
国債補完供給	+40,300
金融調節合計	+41,000
当座預金増減	+34,400

### <7月26日のオベ予想>

朝一の金融調節はノーオベ (当預残543兆1,700億円)で 無担保コール0/Nは-0.085%~-0.065% での合いが中心か。
---

### <7月26日9時20分のオベによる日銀当座預金状況>

9時20分のオベ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,476,700	+79,400
+40,000	5,471,700	+74,400
+35,000	5,466,700	+69,400
+30,000	5,461,700	+64,400
+25,000	5,456,700	+59,400
+20,000	5,451,700	+54,400
+15,000	5,446,700	+49,400
+10,000	5,441,700	+44,400
+5,000	5,436,700	+39,400
±0	5,431,700	+34,400
-5,000	5,426,700	+29,400
-10,000	5,421,700	+24,400
-15,000	5,416,700	+19,400
-20,000	5,411,700	+14,400
-25,000	5,406,700	+9,400
-30,000	5,401,700	+4,400
-35,000	5,396,700	-600
-40,000	5,391,700	-5,600
-45,000	5,386,700	-10,600

### <7月25日 日銀オベ入札結果>

※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/ 7/26	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.045%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 7/26	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.251%
(10:10) 国庫短期証券買	23/ 7/26	1,000億 応札 9,090億 落札 1,000億	最低 +0.018% 平均 +0.019% 按分 97.8%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 7/27-23/ 8/ 3	応札 1ml 落札 1ml	貸付 5.540%
(11:50) 国債補完供給	23/ 7/25-23/ 7/26	応札 40,480億 落札 40,480億	全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 7/25-23/ 7/26	応札 29億 落札 29億	全取 -0.350% 平均 -0.360%

### <7月25日 各オベ残高と内訳>

(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)	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
100,191	74,167	47,883	754,212	1,001
7/19~ 8/ 2 8,970.	7/18(1-3Y) 4,251.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	9/17~ 9/15 13,014.	8/20~ 8/18 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	7/18(3-5Y) 4,500.	9/ 4~ 9/ 4 34.	12/16~12/15 20,601.	11/19~11/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	7/18(5-10Y) 6,758.	12/ 4~12/ 4 10,258.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.
1/10~ 1/10 20,011.	7/18(25Y-) 1,000.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	6/19~ 6/19 63,179.	5/17~ 5/17 0.
1/13~ 1/14 20,008.	7/21(1-3Y) 4,255.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	8/19~ 8/19 381.
1/16~ 1/16 20,009.	7/21(3-5Y) 4,505.	12/ 2~12/ 2 1,712.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	11/18~11/18 93.
1/19~ 1/20 1,163.	7/21(5-10Y) 6,753.	7/20~ 7/27 0.	7/27~ 8/ 3 1.)	2/17~ 2/17 346.
	7/21(10-25Y) 2,003.	※直近約1年分の期落ち分を記載	米ドル資金供給オベ	5/12~ 5/12 181.
		※直近約1年分の期落ち分を記載	0百万ドル	
		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.	9/ 2~ 9/ 5 6,101.	
		12/ 2~12/ 4 3,607.	12/ 2~12/ 4 3,607.	
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.	3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
		6/ 2~ 6/ 3 5,566.	6/ 2~ 6/ 3 5,566.	
		国債買入先オベ	0	
		国債売入先(米ドルオベ用担保)	0	
		国庫短期証券買入額(月初末)	0	
		国債売入先オベ	2,002	
		※直近約1週間の実施分を記載	7/ 5 1,001.	
		国債買入額(固定利回)(月初末)	7/12 1,001.	
		0	(7/26 1,000.)	
		C P買入額(月初末)	3,996	
		7/14 3,996.	7/14 3,996.	
		社債買入額(月初末)	1,002	
		7/24 1,002.	7/24 1,002.	
		J-REIT買入額	6,823	
		約定 22/ 6/14 12.	約定 22/ 6/14 12.	
		ETF買入額	356,220	
		約定 23/ 3/14 701.	約定 23/ 3/14 701.	

※成長基盤強化支援資金供給の各オベは、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  
各資金供給オベの貸付残高は、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25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	6M	1M	3M	6M	1M	3M	6M
0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000
1W	売気配	-0.020	2M	0.000000	3M	買気配	-0.130	買気配	-0.100
2W	売気配	-0.020	3M	+0.040000	1Y	買気配	-0.030		
1M	売気配	-0.020							

### <7月24日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	186,452	+1,961
有担保	31,149	+181
無担保	155,303	+1,780

### <7月25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	-0.074	-0.001					-0.093	+0.002
トムネ									-0.097	+0.003
スポネ										
1週間物	-0.075	-0.055	-0.071	-0.005					-0.106	-0.001
2週間物	-0.050	0.000	-0.033	+0.036					-0.109	+0.001
3週間物			-0.075	-0.010					-0.115	±0
1ヶ月物									-0.118	+0.001
3ヶ月物									-0.129	+0.001
6ヶ月物									-0.134	+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、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