

# 東京短資デイリーレポート

2023/8/1

## <7月31日のマネタリーベース>

6,688,600
-----------

## <8月1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	5,457,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,428,100
日銀当座預金残高増減前日比	+28,900

## <8月1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	-25,100	
資金過不足	-25,000	
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+3,200
国庫短期証券買入		+1,000
国債補完供給	+50,900	-49,500
金融調節合計		+5,600
当座預金増減-②		-19,400

## <8月1日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,408,700
準備預金残高	4,713,300
積み終了先	4,712,000
超過準備	4,711,700
非準備先残高	695,400

## <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)	10,300
残り要積立額(平均)	700
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	54.8
進捗率乖離幅	+44.9

## <8月2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	+600	
財政等要因	-91,300	
資金過不足	-90,700	
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-9,000	+5,000
国債補完供給	+49,500	
金融調節合計		+45,500
当座預金増減		-45,200

## <8月2日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残536兆3,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.080%~-0.060% での出合いが中心か。
--

## <8月2日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,408,500	-200
+40,000	5,403,500	-5,200
+35,000	5,398,500	-10,200
+30,000	5,393,500	-15,200
+25,000	5,388,500	-20,200
+20,000	5,383,500	-25,200
+15,000	5,378,500	-30,200
+10,000	5,373,500	-35,200
+5,000	5,368,500	-40,200
±0	5,363,500	-45,200
-5,000	5,358,500	-50,200
-10,000	5,353,500	-55,200
-15,000	5,348,500	-60,200
-20,000	5,343,500	-65,200
-25,000	5,338,500	-70,200
-30,000	5,333,500	-75,200
-35,000	5,328,500	-80,200
-40,000	5,323,500	-85,200
-45,000	5,318,500	-90,200

## <8月1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/ 8/ 2	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.400%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 8/ 2	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.610%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 8/ 3-23/ 8/10	応札	0mil	落札	0mil	貸付	5.580%
(11:50) 国債補完供給	23/ 8/ 1-23/ 8/ 2	応札	50,128億	落札	50,128億	全取	-0.350%
(13:00) 共通担保(全)国	23/ 8/ 2-23/ 8/16	応札	5,000億	落札	5,000億	平均	-0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 8/ 1-23/ 8/ 2	応札	0億	落札	0億	貸付	0.000%

## <8月1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	100,191	国債買入額(月初末)	3,002	成長基盤強化支援資金供給	47,883	貸出増加支援資金供給	754,212	被災地金融機関支援資金供給	1,001
7/19~ 8/ 2	8,970.	7/27(3-5Y)	4,506.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	9/17~ 9/15	13,014.	8/20~ 8/18	0.
( 8/ 2~ 8/16	5,000.)	7/27(5-10Y)	6,756.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.	11/19~11/17	0.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/27(10-25Y)	2,002.	12/ 4~12/ 4	10,258.	3/18~ 3/18	41,458.	2/18~ 2/16	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	7/27(25Y-)	1,003.	3/ 4~3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.	5/17~ 5/17	0.
1/10~ 1/10	20,011.	7/27(物国)	600.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	※直近約1年分の期落ち分を記載		8/19~ 8/19	381.
1/13~ 1/14	20,008.	8/ 1(5-10Y)	3,002.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	米ドル資金供給オペ		11/18~11/18	93.
1/16~ 1/16	20,009.			12/ 2~12/ 2	1,712.	1百万ドル		2/17~ 2/17	346.
1/19~ 1/20	1,163.			3/ 3~ 3/ 3	6,793.	( 8/ 3~ 8/10	0.)	5/12~ 5/12	181.
				※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)					
				0					
				国債売現先オペ					
				0					
				8/ 1	1,002.				
				※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					
				国債補完供給					
				7/31(5-10Y)	8,429.				
				50,128					
				8/ 1~ 8/ 2	50,128.				
				8/ 1~ 8/ 2	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					
				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					
				62,648					
				成長基盤強化支援					
				43,417					
				貸出増加支援					
				683,578					
				手形売出					
				0					
				国債売現先					
				0					
				供給オペ合計					
				930,856					
				国債補完供給					
				50,128					
				貸出(推定)					
				0					
				国債売現先(米ドル担保)					
				0					
				供給額合計					
				930,856					
				吸収額合計					
				50,128					
				差し引き					
				880,728					

※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1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	-----	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31日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	195,122	+5,619
有担保	29,881	-1,523
無担保	165,241	+7,142

## <8月1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	-0.063	-0.002				-----	-0.091	+0.002
トムネ				-----				-----	-0.095	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物			-0.065	-0.018				-----	-0.106	±0
2週間物			-0.035	-0.056				-----	-0.108	+0.003
3週間物				-----				-----	-0.113	+0.001
1ヶ月物				-----				-----	-0.120	-0.001
3ヶ月物			0.028	-----				-----	-0.128	±0
6ヶ月物				-----				-----	-0.129	+0.001
1年物				-----				-----	-0.101	±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