

東京短資デイリーレポート

2023/8/2

<8月1日のマナリーベース>

6,669,000

<8月2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	5,363,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,408,700
日銀当座預金残高増減前日比	-45,200

<8月2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		+600
財政等要因		-92,400
資金過不足		-91,800
金融調節		
共通担保(全店)	期落	新規
	-9,000	+5,000
国債補充供給	+49,500	-42,400
金融調節合計		+3,100
当座預金増減-②		-88,700

<8月2日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,320,000
準備預金残高	4,645,200
積み終了先	4,644,100
超過準備	4,644,100
非準備先残高	674,800

<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)	9,200
残り要積立額(平均)	700
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	58.1
進捗率乖離幅	+41.6

<8月3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		-800
財政等要因		+2,000
資金過不足		+1,200
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
		+18,100
CP等買入		-100
国債補充供給	+42,400	
金融調節合計		+60,400
当座預金増減		+61,600

<8月3日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残538兆1,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.085%~-0.065% での合いが中心か。

<8月3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	5,426,600	+106,600
+40,000	5,421,600	+101,600
+35,000	5,416,600	+96,600
+30,000	5,411,600	+91,600
+25,000	5,406,600	+86,600
+20,000	5,401,600	+81,600
+15,000	5,396,600	+76,600
+10,000	5,391,600	+71,600
+5,000	5,386,600	+66,600
±0	5,381,600	+61,600
-5,000	5,376,600	+56,600
-10,000	5,371,600	+51,600
-15,000	5,366,600	+46,600
-20,000	5,361,600	+41,600
-25,000	5,356,600	+36,600
-30,000	5,351,600	+31,600
-35,000	5,346,600	+26,600
-40,000	5,341,600	+21,600
-45,000	5,336,600	+16,600

<8月2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-3Y)	23/ 8/ 3	4,250億 応札 10,843億 落札 4,258億 最低 +0.005% 平均 +0.006% 按分 66.0%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 8/ 3	4,500億 応札 7,355億 落札 4,503億 最低 +0.011% 平均 +0.013% 按分 77.1%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 8/ 3	6,750億 応札 14,568億 落札 6,755億 最低 +0.012% 平均 +0.013% 按分 71.8%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 8/ 3	2,000億 応札 3,660億 落札 2,008億 最低 +0.015% 平均 +0.018% 按分 75.1%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/ 8/ 3	1,000億 応札 2,695億 落札 1,000億 最低 +0.017% 平均 +0.019% 按分 20.1%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 8/ 3	応札 0億 落札 0億 固定利回差差 +0.410%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 8/ 3	応札 0億 落札 0億 固定利回差差 +0.635%
(11:50) 国債補充供給	23/ 8/ 2-23/ 8/ 3	応札 42,806億 落札 42,806億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給	23/ 8/ 2-23/ 8/ 3	応札 79億 落札 79億 全取 -0.350% 平均 -0.350%

<8月2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	国債買入額(月初末)	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給	
9 6, 2 2 1	3, 0 0 2	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
8/ 2~ 8/16 5,000.	7/27(3-5Y) 4,506.	4 7, 8 8 3	7 5 4, 2 1 2	8/20~ 8/18 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	7/27(5-10Y) 6,756.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	9/17~ 9/15 13,014.	11/19~11/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	7/27(10-25Y) 2,002.	9/ 4~ 9/ 4 34.	12/16~12/15 20,601.	2/18~ 2/16 0.
1/10~ 1/10 20,011.	7/27(25Y-) 1,003.	12/ 4~12/ 4 10,258.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/13~ 1/14 20,008.	7/27(物国) 600.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/16~ 1/16 20,009.	8/ 1(5-10Y) 3,002.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.		11/18~11/18 93.
1/19~ 1/20 1,163.	(8/ 3(1-3Y) 4,258.)	9/ 2~ 9/ 2 1,804.		2/17~ 2/17 346.
	(8/ 3(3-5Y) 4,503.)	12/ 2~12/ 2 1,712.	※直近約1年分の期落ち分を記載	5/12~ 5/12 181.
	(8/ 3(5-10Y) 6,755.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	米ドル資金供給オペ	
	(8/ 3(10-25Y) 2,008.)		1 百万ドル	
	(8/ 3(25Y-) 1,000.)		7/27~ 8/ 3 1.	
			(8/ 3~ 8/10 0.)	
			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)	
			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	
			国債補充供給	
			7/31(5-10Y) 8,429.	
			4 2, 8 8 5	
			8/ 2~ 8/ 3 42,806.	
			8/ 2~ 8/ 3 79.	
			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	
			C P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	
			供給オペ合計	
			926,886	
			国債補充供給	
			42,885	
			貸出(推定)	
			0	
			国債売現先	
			0	
			供給額合計	
			926,886	
			吸収額合計	
			42,885	
			差し引き	
			884,001	

※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2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		

<8月1日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	186,353	-8,769
有担保	29,995	+114
無担保	156,358	-8,883

<8月2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	-0.070	-0.007					-0.092	-0.001
トムネ									-0.100	-0.005
スポネ										
1週間物			0.001	+0.066					-0.104	+0.002
2週間物	-0.060	0.001	-0.053	+0.003					-0.111	-0.003
3週間物			0.001						-0.115	-0.002
1ヶ月物			0.001						-0.119	+0.001
3ヶ月物									-0.128	±0
6ヶ月物									-0.129	±0
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