

東京短資デイリーレポート

2023/8/7

<8月4日のマナリーベース>

6,610,800

<8月7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	5,388,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,350,600
日銀当座預金残高増減前日比	+38,300

<8月7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		+300
財政等要因		+5,100
資金過不足		+5,400
金融調節		
CP等買入	期落	新規
	-100	
国債補充供給	+34,900	-31,300
金融調節合計		+3,500
当座預金増減-②		+8,900

<8月7日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,359,500
準備預金残高	4,676,900
積み終了先	4,676,400
超過準備	4,675,900
非準備先残高	682,600

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,017,300
今積み期間所要準備額 (平均)	129,600
残り要積立額 (積数)	2,400
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	74.2
進捗率乖離幅	+25.7

<8月8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		-200
財政等要因		-100
資金過不足		-300
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
	-100	
国債補充供給	+31,300	
金融調節合計		+31,200
当座預金増減		+30,900

<8月8日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残539兆400億円)で 無担保コール0/Nは-0.085%~-0.065% での合いが中心か。

<8月8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	5,435,400	+75,900
+40,000	5,430,400	+70,900
+35,000	5,425,400	+65,900
+30,000	5,420,400	+60,900
+25,000	5,415,400	+55,900
+20,000	5,410,400	+50,900
+15,000	5,405,400	+45,900
+10,000	5,400,400	+40,900
+5,000	5,395,400	+35,900
± 0	5,390,400	+30,900
-5,000	5,385,400	+25,900
-10,000	5,380,400	+20,900
-15,000	5,375,400	+15,900
-20,000	5,370,400	+10,900
-25,000	5,365,400	+5,900
-30,000	5,360,400	+900
-35,000	5,355,400	-4,100
-40,000	5,350,400	-9,100
-45,000	5,345,400	-14,100

<8月7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/ 8	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.360%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 8/ 8	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.565%
(11:50) 国債補充供給	23/ 8/ 7-23/ 8/ 8	応札	31,817億	落札	31,817億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給	23/ 8/ 7-23/ 8/ 8	応札	4億	落札	4億	全取	-0.350% 平均 -0.350%

<8月7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)	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					
96,221	25,531			1,001					
8/ 2~ 8/16	5,000.	8/ 1(5-10Y)	3,002.	47,883	754,212	8/20~ 8/18	0.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	8/ 3(1-3Y)	4,258.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	9/17~ 9/15	13,014.	11/19~11/17	0.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	8/ 3(3-5Y)	4,503.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.	2/18~ 2/16	0.
1/10~ 1/10	20,011.	8/ 3(5-10Y)	6,755.	12/ 4~12/ 4	10,258.	3/18~ 3/18	41,458.	5/17~ 5/17	0.
1/13~ 1/14	20,008.	8/ 3(10-25Y)	2,008.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.	8/19~ 8/19	381.
1/16~ 1/16	20,009.	8/ 3(25Y)	1,000.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	※直近約1年分の期落ち分を記載		11/18~11/18	93.
1/19~ 1/20	1,163.	8/ 4(3-5Y)	1,000.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	米ドル資金供給オペ		2/17~ 2/17	346.
		8/ 4(5-10Y)	3,005.	12/ 2~12/ 2	1,712.	0百万ドル		5/12~ 5/12	181.
				3/ 3~ 3/ 3	6,793.	8/ 3~ 8/10		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					
				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			
						国庫短期証券買入額(月初末)			
				国債売現先オペ		1,002			
				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.	
				31,821					
				8/ 7~ 8/ 8		31,817.			
				8/ 7~ 8/ 8		4.			
				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)固定金利					
				96,221					
				成長基盤強化支援資金供給					
				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					
				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	
				新型コロナウイルス金融支援		0		国債売現先	
				0		0		0	
				供給オペ合計		926,886		国債補充供給	
				926,886		31,821		31,821	
				貸出(推定)		0		国債売現先(米ドル担保)	
				0		0		0	
				供給額合計		926,886		吸収額合計	
				926,886		31,821		31,821	
				差し引き		895,065			

※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7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	0.000000	3M	買気配 -0.080
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.150
2W	売気配 -0.020	3M	0.000000	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

<8月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	177,207	-625
有担保	30,432	-681
無担保	146,775	+56

<8月7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	-0.075	-0.003				-----	-0.096	± 0
トムネ				-----				-----	-0.103	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.070	-0.068	-0.069	-0.021				-----	-0.106	± 0
2週間物	-0.068	0.030	-0.057	-0.039				-----	-0.109	± 0
3週間物				-----				-----	-0.114	± 0
1ヶ月物				-----				-----	-0.119	+0.001
3ヶ月物			0.004	-----				-----	-0.123	+0.003
6ヶ月物				-----				-----	-0.129	± 0
1年物				-----				-----	-0.100	+0.001

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