

# 東京短資デイリーレポート

2023/8/10

### <8月9日のマナリーベース>

6,612,000
-----------

### <8月10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	5,413,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,351,500
日銀当座預金残高増減前日比	+61,700

### <8月10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	+15,400	
資金過不足	+14,800	
金融調節		
国債買入	期落	新規
		+17,500
CP等買入	-800	
社債等買入	-100	
国債補充供給	+29,800	-29,100
金融調節合計		+17,300
当座預金増減-②		+32,100

### <8月10日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,383,600
準備預金残高	4,694,900
積み終了先	4,694,900
超過準備	4,694,600
非準備先残高	688,700

### <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)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	93.5
進捗率乖離幅	+6.5

### <8月14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	+400	
財政等要因	+200	
資金過不足	+600	
金融調節確定分		
国債補充供給	期落	新規
	+29,100	
金融調節合計		+29,100
当座預金増減		+29,700

### <8月14日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆3,300億円)で 無担保コール0/Nは-0.085%~-0.065% での合いが中心か。
---

### <8月14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	5,458,300	+74,700
+40,000	5,453,300	+69,700
+35,000	5,448,300	+64,700
+30,000	5,443,300	+59,700
+25,000	5,438,300	+54,700
+20,000	5,433,300	+49,700
+15,000	5,428,300	+44,700
+10,000	5,423,300	+39,700
+5,000	5,418,300	+34,700
±0	5,413,300	+29,700
-5,000	5,408,300	+24,700
-10,000	5,403,300	+19,700
-15,000	5,398,300	+14,700
-20,000	5,393,300	+9,700
-25,000	5,388,300	+4,700
-30,000	5,383,300	-300
-35,000	5,378,300	-5,300
-40,000	5,373,300	-10,300
-45,000	5,368,300	-15,300

### <8月10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(固)(5Y-10Y)	23/ 8/14	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.435%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 8/14	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.641%
(11:50) 国債補充供給	23/ 8/10-23/ 8/14	応札	29,398億	落札	29,398億	全取	-0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補充供給	23/ 8/10-23/ 8/14	応札	1億	落札	1億	全取	-0.350% 平均 -0.360%

### <8月10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	96,221	国債買入額(月初末)	43,051	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	1,001
8/ 2~ 8/16	5,000.	8/ 3(1-3Y)	4,258.	47,883		754,212		8/20~ 8/18	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	8/ 3(3-5Y)	4,503.	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(5-10Y)	6,755.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.	2/18~ 2/16	0.
1/10~ 1/10	20,011.	8/ 3(10-25Y)	2,008.	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(25Y-)	1,000.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.	8/19~ 8/19	381.
1/16~ 1/16	20,009.	8/ 4(3-5Y)	1,000.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.			11/18~11/18	93.
1/19~ 1/20	1,163.	8/ 4(5-10Y)	3,005.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.			2/17~ 2/17	346.
		8/10(1-3Y)	4,255.	12/ 2~12/ 2	1,712.			5/12~ 5/12	181.
		8/10(3-5Y)	4,505.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.				
		8/10(5-10Y)	6,756.						
		8/10(10-25Y)	2,004.						
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.								
国債補充供給	29,399								
8/10~ 8/14	29,398.								
8/10~ 8/14	1.								
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.								
国債買入先オペ	0								
国債売先オペ(米ドルオペ用担保)	0								
国債売先オペ	2,004								
8/ 1	1,002.								
8/ 9	1,002.								
国債短期証券買入額(月初末)									
国債売先オペ	0								
8/ 1	1,002.								
8/ 9	1,002.								
CP買入額(月初末)	0								
( 8/15	4,001.)								
社債買入額(月初末)	0								
国債買入先	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								
貸出(推定)	0								
供給額合計	926,886								
国債売先	0								
国債補充供給	29,399								
国債売先(米ドル担保)	0								
吸収額合計	29,399								
差し引き	897,487								

※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10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	+0.020000	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	+0.015000	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

### <8月9日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	181,750	+7,337
有担保	31,051	+98
無担保	150,699	+7,239

### <8月10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	-0.072	+0.002				-----	-0.098	+0.005
トムネ				-----				-----	-0.101	+0.046
スポネ				-----				-----		
1週間物			-0.010	-----				-----	-0.107	+0.026
2週間物				-----				-----	-0.112	+0.015
3週間物				-----				-----	-0.116	+0.010
1ヶ月物			-0.033	-----				-----	-0.124	+0.011
3ヶ月物				-----				-----	-0.122	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	-0.131	-0.001
1年物				-----				-----	-0.100	±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