

# 東京短資デイリーレポート

2023/8/18

## <8月17日のマナタリーベース>

6,714,900
-----------

## <8月18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	5,476,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,454,900
日銀当座預金残高増減前日比	+22,000

## <8月18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	+400
財政等要因	-14,300
資金過不足	-13,900
金融調節	
CP等買入	-400
国債補充供給	+32,500
金融調節合計	+400
当座預金増減-②	-13,500

## <8月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,441,400
準備預金残高	4,745,100
積み終了先	4,737,000
超過準備	4,724,600
非準備先残高	696,300

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,009,600
今積み期間所要準備額(平均)	129,300
残り要積立額(積数)	34,700
残り要積立額(平均)	1,300
準備進捗率(%)	99.1
日数進捗率(%)	16.1
進捗率乖離幅	+83.0

## <8月21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	+500
財政等要因	+5,100
資金過不足	+5,600
金融調節確定分	
CP等買入	-100
国債補充供給	+31,700
金融調節合計	+31,600
当座預金増減	+37,200

## <8月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆8,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.080%~-0.060% での合いが中心か。
-----------------------------------------------------------------------------

## <8月21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	5,523,600	+82,200
+40,000	5,518,600	+77,200
+35,000	5,513,600	+72,200
+30,000	5,508,600	+67,200
+25,000	5,503,600	+62,200
+20,000	5,498,600	+57,200
+15,000	5,493,600	+52,200
+10,000	5,488,600	+47,200
+5,000	5,483,600	+42,200
±0	5,478,600	+37,200
-5,000	5,473,600	+32,200
-10,000	5,468,600	+27,200
-15,000	5,463,600	+22,200
-20,000	5,458,600	+17,200
-25,000	5,453,600	+12,200
-30,000	5,448,600	+7,200
-35,000	5,443,600	+2,200
-40,000	5,438,600	-2,800
-45,000	5,433,600	-7,800

## <8月18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/ 8/21	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.350%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 8/21	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.560%
(11:50) 国債補充供給	23/ 8/18-23/ 8/21	応札	32,235億	落札	32,235億	全取	-0.350% 平均 -0.352%
(13:50) 国債補充供給	23/ 8/18-23/ 8/21	応札	0億	落札	0億		

## <8月18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)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給					
9 8, 4 7 1	5 6, 5 6 6	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1, 0 0 1					
8/16~ 8/30	7,250.	8/17(-1Y)	1,503.	4 7, 8 8 3	7 5 4, 2 1 2	11/19~11/17	0.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	8/17(1-3Y)	4,255.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	9/17~ 9/15	13,014.	2/18~ 2/16	0.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	8/17(5-10Y)	6,756.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.	5/17~ 5/17	0.
1/10~ 1/10	20,011.	8/17(25Y-)	1,001.	12/ 4~12/ 4	10,258.	3/18~ 3/18	41,458.	8/19~ 8/19	381.
1/13~ 1/14	20,008.			3/ 4~ 3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.	11/18~11/18	93.
1/16~ 1/16	20,009.			6/ 3~ 6/ 3	1,950.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	2/17~ 2/17	346.
1/19~ 1/20	1,163.			12/ 2~12/ 2	1,712.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	5/12~ 5/12	181.
				3/ 3~ 3/ 3	6,793.	8/17~ 8/24	1.	8/18~ 8/18	0.
						※直近約1年分の期落ち分を記載			
						米ドル資金供給オペ			
						1 百万ドル			
						8/17~ 8/24	1.		
						※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			
						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)			
						2			
						8/16~ 8/25	2.		
						国庫短期証券買入額(月初末)			
						国債売現先オペ			
						0			
						8/ 1	1,002.		
						8/ 9	1,002.		
						8/16	1,003.		
						※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			
						3 2, 2 3 5			
						8/18~ 8/21	32,235.		
						8/18~ 8/21	0.		
						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			
						共通担保(全店)金利入札			
						4 0, 0 2 1			
						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)			
						4, 0 0 1			
						8/15	4,001.		
						社債買入額(月初末)			
						0			
						( 8/22	1,000.)		
						貸出増加支援	683,578	手形売出	0
						新型コロナウイルス企業金融支援	0	国債売現先	0
						供給オペ合計	929,136	国債補充供給	32,235
						貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	2
						供給額合計	929,136	吸収額合計	32,237
						差し引き	896,899		

※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18日のオープン市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP現先		CPプライマリー		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 -0.140
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.100
1M	売気配 -0.020				

## <8月17日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	170,911	+12,785
有担保	29,023	-171
無担保	141,888	+12,956

## <8月18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	-0.064	±0				-----	-0.114	-0.014
トムネ				-----				-----	-0.120	+0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	-0.117	±0
2週間物	-0.062	-0.003	-0.033	+0.017				-----	-0.120	-0.002
3週間物			-0.060	-0.015				-----	-0.123	-0.001
1ヶ月物			-0.060	-----				-----	-0.129	-0.002
3ヶ月物			0.025	-----				-----	-0.127	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	-0.124	+0.004
1年物				-----				-----	-0.092	+0.002

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