

# 東京短資デイリーレポート

2023/8/22

## <8月21日のマナリーベース>

6,704,700
-----------

## <8月22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	5,472,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,445,600
日銀当座預金残高増減前日比	+26,700

## <8月22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		-7,500
資金過不足		-7,400
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-300	
社債等買入		+1,000
国債補完供給	+32,800	-31,400
金融調節合計		+2,100
当座預金増減-②		-5,300

## <8月22日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,440,300
準備預金残高	4,737,000
積み終了先	4,734,200
超過準備	4,733,800
非準備先残高	703,300

## <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)	26,600
残り要積立額 (平均)	1,100
準備進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	22.6
進捗率乖離幅	+76.7

## <8月23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		+100
財政等要因		-6,600
資金過不足		-6,500
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
国債補完供給	+31,400	
金融調節合計		+32,400
当座預金増減		+25,900

## <8月23日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆6,200億円)で 無担保コール0/Nは-0.080%~-0.060% での合いが中心か。
---

## <8月23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	5,511,200	+70,900
+40,000	5,506,200	+65,900
+35,000	5,501,200	+60,900
+30,000	5,496,200	+55,900
+25,000	5,491,200	+50,900
+20,000	5,486,200	+45,900
+15,000	5,481,200	+40,900
+10,000	5,476,200	+35,900
+5,000	5,471,200	+30,900
±0	5,466,200	+25,900
-5,000	5,461,200	+20,900
-10,000	5,456,200	+15,900
-15,000	5,451,200	+10,900
-20,000	5,446,200	+5,900
-25,000	5,441,200	+900
-30,000	5,436,200	-4,100
-35,000	5,431,200	-9,100
-40,000	5,426,200	-14,100
-45,000	5,421,200	-19,100

## <8月22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/ 8/23	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/ 8/23	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.565%
(10:10) 国庫短期証券買入	23/ 8/23	1,000億	応札	3,581億	落札	1,000億	全取 +0.010% 平均 +0.010%
(10:40) 米ドル資金供給	23/ 8/24-23/ 8/31	応札	1ml	落札	1ml	貸付	5.580%
(11:50) 国債補完供給	23/ 8/22-23/ 8/23	応札	31,826億	落札	31,826億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 8/22-23/ 8/23	応札	11億	落札	11億	全取	-0.350% 平均 -0.350%

## <8月22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	98,471	国債買入額(月初末)	56,566	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		
8/16~ 8/30	7,250.	8/17(-1Y)	1,503.	47,883	754,212	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.			2/17~ 2/17	346.
1/19~ 1/20	1,163.			9/ 2~ 9/ 2	1,804.	※直近約1年分の期落ち分を記載		5/12~ 5/12	181.
				12/ 2~12/ 2	1,712.	米ドル資金供給オペ		8/18~ 8/18	0.
				3/ 3~ 3/ 3	6,793.	1百万ドル			
						8/17~ 8/24		1.	
						(8/24~ 8/31)		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			
						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)			
						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			
						3,007			
						0			
						8/ 1		1,002.	
						8/ 9		1,002.	
						8/16		1,003.	
						(8/23		1,000.)	
						C P買入額(月初末)			
						4,001			
						8/15		4,001.	
						社債買入額(月初末)			
						1,000			
						8/22		1,000.	
						J-REIT買入額			
						6,823			
						約定 22/ 6/14		12.	
						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.	
						無担保コール			
						6,823			
						約定 22/ 6/14		12.	

※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22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	+0.006000	3M	買気配 -0.100
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

## <8月21日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	185,580	+1,974
有担保	27,983	+21
無担保	157,597	+1,953

## <8月22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	+0.001				-----	-0.108	-0.002
トムネ				-----				-----	-0.132	-0.011
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.072	-0.060	-0.066	-0.006				-----	-0.125	-0.007
2週間物			-0.060	+0.008				-----	-0.126	-0.005
3週間物				-----				-----	-0.129	-0.006
1ヶ月物				-----				-----	-0.137	-0.008
3ヶ月物				-----				-----	-0.128	-0.002
6ヶ月物				-----				-----	-0.124	-0.002
1年物				-----				-----	-0.092	-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