

東京短資デイリーレポート

2024/4/8

<4月5日のマナリーベース>

6,831,800

<4月8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	5,609,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,578,000
日銀当座預金残高増減前日比	+31,500

<4月8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		+1,000
財政等要因		-2,300
資金過不足		-1,300
金融調節		
CP等買入	期落	新規
	-500	
国債補充供給	+36,400	-42,100
金融調節合計		-6,200
当座預金増減-②		-7,500

<4月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,570,500
準備預金残高	4,900,800
積み終了先	4,900,800
超過準備	4,900,800
非準備先残高	669,700

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,056,600
今積み期間所要準備額(平均)	130,900
残り要積立額(積数)	100
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	77.4
進捗率乖離幅	+22.5

<4月9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		+700
財政等要因		+10,300
資金過不足		+11,000
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
		+9,200
国債補充供給	+42,100	
金融調節合計		+51,300
当座預金増減		+62,300

<4月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残563兆2,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<4月9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	5,677,800	+107,300
+40,000	5,672,800	+102,300
+35,000	5,667,800	+97,300
+30,000	5,662,800	+92,300
+25,000	5,657,800	+87,300
+20,000	5,652,800	+82,300
+15,000	5,647,800	+77,300
+10,000	5,642,800	+72,300
+5,000	5,637,800	+67,300
±0	5,632,800	+62,300
-5,000	5,627,800	+57,300
-10,000	5,622,800	+52,300
-15,000	5,617,800	+47,300
-20,000	5,612,800	+42,300
-25,000	5,607,800	+37,300
-30,000	5,602,800	+32,300
-35,000	5,597,800	+27,300
-40,000	5,592,800	+22,300
-45,000	5,587,800	+17,300

<4月8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)	24/ 4/ 9	3,750億 応札 11,680億 落札 3,755億 最低 +0.008% 平均 +0.009% 按分 4.3%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 4/ 9	4,750億 応札 6,532億 落札 4,753億 最低 +0.008% 平均 +0.013% 按分 29.7%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/ 4/ 9	750億 応札 1,902億 落札 755億 最低 +0.025% 平均 +0.026% 按分 54.0%
(11:50) 国債補充供給	24/ 4/ 8-24/ 4/ 9	応札 42,541億 落札 42,541億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補充供給	24/ 4/ 8-24/ 4/ 9	応札 18億 落札 18億 全取 -0.150% 平均 -0.150%

<4月8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
99,226	11,016	成長基盤強化支援資金供給	1,001
4/ 3~ 4/17 8,005.	4/ 4(-1Y) 1,501.	33,473	864,191
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	4/ 4(1-3Y) 3,754.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	4/ 4(3-5Y) 4,257.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/10~ 1/10 20,011.	4/ 4(10-25Y) 1,504.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/13~ 1/14 20,008.	(4/ 9(1-3Y) 3,755.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/16~ 1/16 20,009.	(4/ 9(5-10Y) 4,753.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	(4/ 9(25Y-) 755.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	8/18~ 8/18 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.	11/17~11/17 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	2/16~ 2/16 0.
			米ドル資金供給オペ
			0百万ドル
			4/ 4~ 4/11 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
			16,370百万ドル
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.
			12/ 4~12/ 4 3,325.
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			0
			国債短期証券買入額(月初末)
			0
			国債売現先オペ
			0
			※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
			42,559
			4/ 8~ 4/ 9 42,541.
			4/ 8~ 4/ 9 18.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			C P買入額(月初末)
			0
			社債買入額(月初末)
			0
			<4月8日 日銀信用概算(除く買切)>
			共通担保(全)固定 99,226 CP等買入(推定) 21,500
			共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 60,900
			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 81,663
			成長基盤支援 28,711 手形売切 0
			貸出増加支援 782,979 国債売現先 0
			供給オペ合計 1,063,615 国債補充供給 42,559
			貸出(推定) 0 国債現(米ドル担保) 0
			供給額合計 1,063,615 吸収額合計 42,559
			差し引き 1,021,056

※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。

<4月8日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリー		TBアウトライイト	
	1M	3M	1M	3M	3M	6M
0.000	1M	+0.140000	3M	買気配 +0.050		
1W 売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 +0.100		
2W 売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 +0.150		
1M 売気配 -0.020						

<4月5日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高		増減
	有担保	無担保	
市場合計	120,075	33,609	-4,550
有担保	86,466	33,609	-2,083
無担保	33,609	0	-2,467

<4月8日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

翌日物	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
トムネ	0.060	0.078	0.077	±0				-----	0.048	±0
スポネ				-----				-----	0.042	-0.012
1週間物				-----				-----	0.036	-0.003
2週間物			0.140	-----				-----	0.036	-0.001
3週間物				-----				-----	0.037	±0
1ヶ月物			0.220	+0.070				-----	0.035	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.053	±0
6ヶ月物				-----				-----	0.074	-0.001
1年物				-----				-----	0.104	±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