

# 東京短資デイリーレポート

2024/4/12

## <4月11日のマネタリーベース>

6,838,400
-----------

## <4月12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	5,617,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,586,300
日銀当座預金残高増減前日比	+31,100

## <4月12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		-500
資金過不足		-200
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-400	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+35,300	-33,200
金融調節合計		+1,600
当座預金増減-②		+1,400

## <4月12日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,587,700
準備預金残高	4,910,800
積み終了先	4,910,800
超過準備	4,910,800
非準備先残高	676,900

## <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)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	96.8
進捗率乖離幅	+3.2

## <4月15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		+85,500
資金過不足		+85,400
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+12,900
CP等買入	-200	+4,000
社債等買入	-700	
国債補完供給	+33,200	
金融調節合計		+49,200
当座預金増減		+134,600

## <4月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残572兆2,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。
---

## <4月15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	5,767,300	+179,600
+40,000	5,762,300	+174,600
+35,000	5,757,300	+169,600
+30,000	5,752,300	+164,600
+25,000	5,747,300	+159,600
+20,000	5,742,300	+154,600
+15,000	5,737,300	+149,600
+10,000	5,732,300	+144,600
+5,000	5,727,300	+139,600
± 0	5,722,300	+134,600
-5,000	5,717,300	+129,600
-10,000	5,712,300	+124,600
-15,000	5,707,300	+119,600
-20,000	5,702,300	+114,600
-25,000	5,697,300	+109,600
-30,000	5,692,300	+104,600
-35,000	5,687,300	+99,600
-40,000	5,682,300	+94,600
-45,000	5,677,300	+89,600

## <4月12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/ 4/15	3,750億	応札 12,573億	落札 3,757億	最低 0.000%	平均 +0.001%	按分 47.7%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 4/15	4,250億	応札 9,769億	落札 4,257億	最低 -0.011%	平均 -0.009%	按分 17.1%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 4/15	4,750億	応札 11,814億	落札 4,757億	最低 -0.018%	平均 -0.015%	按分 75.7%
(11:50) 国債補完供給	24/ 4/12-24/ 4/15		応札 33,886億	落札 33,886億	全取 -0.150%	平均 -0.150%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 4/12-24/ 4/15		応札 5億	落札 5億	全取 -0.150%	平均 -0.150%	

## <4月12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)	貸出支援基金の運用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	20,279	成長基盤強化支援資金供給	1,001	
4/ 3~ 4/17 8,005.	4/ 9(1-3Y) 3,755.	33,473	864,191	5/17~ 5/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	4/ 9(5-10Y) 4,753.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	4/ 9(25Y-) 755.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/10~ 1/10 20,011.	(4/15(1-3Y) 3,757.)	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/13~ 1/14 20,008.	(4/15(3-5Y) 4,257.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.	(4/15(5-10Y) 4,757.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.		12/ 1~12/ 1 2,464.	11/17~11/17 0.	11/17~11/17 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	米ドル資金供給オペ	2/16~ 2/16 0.
			0百万ドル	
			4/11~ 4/18 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	
			国庫短期証券買入額(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	
			CP買入額(月初末)	
			0	
			(4/15 3,985.)	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			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	
			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。	
			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
			貸出増加支援	782,979
			供給オペ合計	1,063,615
			貸出(推定)	0
			供給額合計	1,063,615
			手形売出	0
			国債売現先	0
			国債補完供給	33,891
			国売現(米ドル担保)	0
			吸収額合計	33,891
			差し引き	1,029,724

## <4月12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		TBアウトライト	
	1M	3M	1M	3M	1Y	3M
	+0.070		+0.130000		買気配 0.000	
1W	売気配 +0.070		+0.190000		買気配 +0.050	
2W	売気配 +0.070		-----		買気配 +0.050	
1M	売気配 +0.070					

## <4月11日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	112,945	-8,460
有担保	34,041	-1,891
無担保	78,904	-6,569

## <4月12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	0.060	0.080	0.077	± 0				-----	0.065	+0.014
トムネ				-----				-----	0.079	+0.024
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.053	+0.009
2週間物				-----				-----	0.051	+0.008
3週間物				-----				-----	0.051	+0.008
1ヶ月物				-----				-----	0.049	+0.009
3ヶ月物				-----				-----	0.055	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.077	± 0
1年物				-----				-----	0.108	± 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