

東京短資デイリーレポート

2024/4/22

<4月19日のマネタリーベース>

6,963,700

<4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	5,741,200	
前日の日銀当座預金残高-①	5,710,500	
日銀当座預金残高増減前日比	+30,700	

<4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	-200
財政等要因	+3,200
資金過不足	+3,000

金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-600	
社債等買入	-500	+1,000
国債補完供給	+29,600	-31,300
金融調節合計		-1,800
当座預金増減-②		+1,200

<4月22日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,711,700
準備預金残高	5,028,400
積み終了先	5,027,200
超過準備	5,027,100
非準備先残高	683,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,955,000
今積み期間所要準備額 (平均)	131,800
残り要積立額 (積数)	7,900
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	23.3
進捗率乖離幅	+76.5

<4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	-1,000
財政等要因	-1,200
資金過不足	-2,200

金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+31,300	
金融調節合計		+31,000
当座預金増減		+28,800

<4月23日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残574兆500億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<4月23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	5,785,500	+73,800
+40,000	5,780,500	+68,800
+35,000	5,775,500	+63,800
+30,000	5,770,500	+58,800
+25,000	5,765,500	+53,800
+20,000	5,760,500	+48,800
+15,000	5,755,500	+43,800
+10,000	5,750,500	+38,800
+5,000	5,745,500	+33,800
± 0	5,740,500	+28,800
-5,000	5,735,500	+23,800
-10,000	5,730,500	+18,800
-15,000	5,725,500	+13,800
-20,000	5,720,500	+8,800
-25,000	5,715,500	+3,800
-30,000	5,710,500	-1,200
-35,000	5,705,500	-6,200
-40,000	5,700,500	-11,200
-45,000	5,695,500	-16,200

<4月22日 日銀オペ入札結果>

時間	国債補完供給	24/4/22-24/4/23	応札	31,877億	落札	31,877億	全取	-0.250%	平均	-0.250%
(11:50)	国債補完供給	24/4/22-24/4/23	応札	31,877億	落札	31,877億	全取	-0.250%	平均	-0.250%
(13:50)	国債補完供給	24/4/22-24/4/23	応札	0億	落札	0億				

<4月22日 各オペ残高と内訳>

共通担保(全店)固定金利		国債買入額(月初来)		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			
98,241	47,321	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1,001		1,001			
4/17~ 5/ 1	7,020.	4/15(1-3Y)	3,757.	33,473	864,191	5/17~ 5/17	0.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	4/15(3-5Y)	4,257.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	6/19~ 6/19	63,179.	8/19~ 8/19	381.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	4/15(5-10Y)	4,757.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.	11/18~11/18	93.
1/10~ 1/10	20,011.	4/18(1-3Y)	3,754.	12/ 2~12/ 2	1,712.	12/15~12/13	54,701.	2/17~ 2/17	346.
1/13~ 1/14	20,008.	4/18(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.	4/18(5-10Y)	4,757.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.			8/18~ 8/18	0.
1/19~ 1/20	1,163.	4/18(10-25Y)	1,503.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.	※直近約1年分の期落ち分を記載		11/17~11/17	0.
				12/ 1~12/ 1	2,464.	米ドル資金供給オペ		2/16~ 2/16	0.
				3/ 2~ 3/ 2	7,922.	1百万ドル			
						4/18~ 4/25	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			
						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)(月初来)	0		
						国債補完供給	31,877		
						4/22~ 4/23	31,877.		
						4/22~ 4/23	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			
						共通担保(全店)金利入札	70,035		
						1/24~ 1/24	10,003.		
						2/ 1~ 2/ 1	10,004.		
						2/15~ 2/15	10,004.		
						3/ 1~ 3/ 1	10,010.		
						9/15~ 9/15	10,005.		
						10/10~10/10	10,006.		
						10/25~10/25	10,003.		
						※直近約1週間の実施分を記載			
						国債買入額(固定利回)(月初来)	0		
						CP買入額(月初来)	3,985		
						4/15	3,985.		
						社債買入額(月初来)	1,001		
						4/22	1,001.		
						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	手形売出	0
						貸出増加支援	782,979	国債売現先	0
						供給オペ合計	1,062,630	国債補完供給	31,877
						貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
						供給額合計	1,062,630	吸収額合計	31,877
						差し引き	1,030,753		

※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		TBアウトライト	
S/N	+0.070	1M買気配	+0.2200Q03M	買気配	+0.050
1W	売気配 +0.070	2M買気配	+0.2010Q06M	買気配	+0.100
2W	売気配 +0.070	3M買気配	+0.1900Q01Y	買気配	+0.200
1M	売気配 +0.070				

<4月19日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	110,852	-871
有担保	37,226	-285
無担保	73,626	-586

<4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	0.045	0.078	0.077	± 0				-----	0.054	+0.021
トムネ				-----				-----	0.068	+0.025
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.240	-----				-----	0.042	+0.011
2週間物			0.160	-----				-----	0.038	+0.007
3週間物			0.170	-----				-----	0.036	+0.005
1ヶ月物			0.150	-0.013				-----	0.034	+0.004
3ヶ月物				-----				-----	0.051	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.075	± 0
1年物				-----				-----	0.109	-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。
非市場債券(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