

東京短資デイリーレポート

2024/4/25

<4月24日のマナタリーベース>

6,957,300

<4月25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	5,731,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,701,300
日銀当座預金残高増減前日比	+30,500

<4月25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	-1,200
財政等要因	-9,400
資金過不足	-10,600
金融調節	
国債買入	期落 新規 +11,500
CP等買入	-300
社債等買入	-200
国債補完供給	+30,900 -32,600
金融調節合計	+9,300
当座預金増減-②	-1,300

<4月25日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,700,000
準備預金残高	5,004,100
積み終了先	5,003,200
超過準備	5,003,200
非準備先残高	695,900

<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)	4,700
残り要積立額 (平均)	200
準備進捗率 (%)	99.8
日数進捗率 (%)	33.3
進捗率乖離幅	+66.5

<4月26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	+9,000
資金過不足	+8,000
金融調節確定分	
CP等買入	期落 新規 -500
社債等買入	-300
国債補完供給	+32,600
金融調節合計	+31,800
当座預金増減	+39,800

<4月26日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残573兆9,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<4月26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	5,784,800	+84,800
+40,000	5,779,800	+79,800
+35,000	5,774,800	+74,800
+30,000	5,769,800	+69,800
+25,000	5,764,800	+64,800
+20,000	5,759,800	+59,800
+15,000	5,754,800	+54,800
+10,000	5,749,800	+49,800
+5,000	5,744,800	+44,800
± 0	5,739,800	+39,800
-5,000	5,734,800	+34,800
-10,000	5,729,800	+29,800
-15,000	5,724,800	+24,800
-20,000	5,719,800	+19,800
-25,000	5,714,800	+14,800
-30,000	5,709,800	+9,800
-35,000	5,704,800	+4,800
-40,000	5,699,800	-200
-45,000	5,694,800	-5,200

<4月25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。

(11:50) 国債補完供給	24/ 4/25-24/ 4/26	応札 33,294億 落札 33,294億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 4/25-24/ 4/26	応札 0億 落札 0億

<4月25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	
98,241	59,189	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
4/17~ 5/ 1 7,020.	4/18(1-3Y) 3,754.	33,473	864,191	5/17~ 5/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	4/18(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.	4/18(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(10-25Y) 1,503.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/13~ 1/14 20,008.	4/25(3-5Y) 4,256.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.	4/25(5-10Y) 4,755.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	4/25(10-25Y) 1,503.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
	4/25(25Y-) 754.	12/ 1~12/ 1 2,464.		2/16~ 2/16 0.
	4/25(物国) 600.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.		
			※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
				国債補完供給
				33,294
				4/25~ 4/26 33,294.
				4/25~ 4/26 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
				CP買入額(月初末)
				3,985
				4/15 3,985.
				(4/30 3,990.)
				社債買入額(月初末)
				1,001
				4/22 1,001.
				※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25日 日銀信用概算(除く買切)>
				共通担保(全)固定 98,241 CP等買入(推定) 21,400
				共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 59,300
				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 1,062,630 国債補完供給 33,294
				貸出(推定) 0 国債現(米ドル担保) 0
				供給額合計 1,062,630 吸収額合計 33,294
				差し引き 1,029,336

<4月25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 +0.180000	3M 買気配 +0.010
1W 売気配 +0.070	2M +0.180000	6M 買気配 +0.100
2W 売気配 +0.070	3M +0.200000	1Y 買気配 +0.200
1M 売気配 +0.070		

<4月24日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	114,895	+5,048
有担保	36,338	-379
無担保	78,557	+5,427

<4月25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	0.078	0.077	± 0					0.004	-0.053
トムネ				-----					0.013	-0.018
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.029	-0.006
2週間物				-----					0.031	-0.005
3週間物				-----					0.033	-0.002
1ヶ月物			0.180	-----					0.034	+0.001
3ヶ月物				-----					0.051	± 0
6ヶ月物				-----					0.075	± 0
1年物				-----					0.109	± 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