

東京短資デイリーレポート

2024/7/4

<7月3日のマナリーベース>

6,689,800

<7月4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	5,473,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,439,900
日銀当座預金残高増減前日比	+34,000

<7月4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		-3,600
財政等要因		+1,700
資金過不足		-1,900
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+10,800
国債補完供給	+25,800	-24,000
金融調節合計		+12,600
当座預金増減-②		+10,700

<7月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,450,600
準備預金残高	4,846,700
積み終了先	4,846,600
超過準備	4,846,600
非準備先残高	603,900

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,942,000
今積み期間所要準備額(平均)	131,400
残り要積立額(積数)	400
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	63.3
進捗率乖離幅	+36.6

<7月5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		-1,700
財政等要因		-4,500
資金過不足		-6,200
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入		-300
国債補完供給	+24,000	
金融調節合計		+23,700
当座預金増減		+17,500

<7月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆8,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月5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	5,513,100	+62,500
+40,000	5,508,100	+57,500
+35,000	5,503,100	+52,500
+30,000	5,498,100	+47,500
+25,000	5,493,100	+42,500
+20,000	5,488,100	+37,500
+15,000	5,483,100	+32,500
+10,000	5,478,100	+27,500
+5,000	5,473,100	+22,500
± 0	5,468,100	+17,500
-5,000	5,463,100	+12,500
-10,000	5,458,100	+7,500
-15,000	5,453,100	+2,500
-20,000	5,448,100	-2,500
-25,000	5,443,100	-7,500
-30,000	5,438,100	-12,500
-35,000	5,433,100	-17,500
-40,000	5,428,100	-22,500
-45,000	5,423,100	-27,500

<7月4日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 7/ 4-24/ 7/ 5	応札 24,635億 落札 24,635億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/ 4-24/ 7/ 5	応札 0億 落札 0億

<7月4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	
9 9, 2 2 6	1 8, 1 2 3	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1, 0 0 1			
6/26~ 7/10 8,005.	7/ 1(3-5Y) 4,252.	3 1, 5 2 3	8 6 8, 6 5 8	8/19~ 8/19	381.		
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	7/ 1(10-25Y) 1,506.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18	93.		
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	7/ 1(25Y-) 752.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17	346.		
1/10~ 1/10 20,011.	7/ 1(物国) 600.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12	0.		
1/13~ 1/14 20,008.	7/ 4(-1Y) 1,500.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12	181.		
1/16~ 1/16 20,009.	7/ 4(1-3Y) 3,754.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	※直近約1年分の期落ち分を記載	8/18~ 8/18	0.		
1/19~ 1/20 1,163.	7/ 4(3-5Y) 4,255.	12/ 1~12/ 1 2,464.	米ドル資金供給オペ	11/17~11/17	0.		
	7/ 4(10-25Y) 1,504.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	0百万ドル	2/16~ 2/16	0.		
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/27~ 7/ 5 0.				
			(7/ 5~ 7/11 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				
			1 6, 1 2 2 百万ドル				
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.				
			12/ 4~12/ 4 3,325.				
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.				
			6/ 3~ 6/ 3 5,318.				
			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(月初来)				
			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				
			2 4, 6 3 5				
			7/ 4~ 7/ 5 24,635.				
			7/ 4~ 7/ 5 0.				
			ETF買入額				
			3 5 6, 9 2 1				
			約定 23/10/ 4 701.				
			ETF買入額(企業支援)				
			1 4, 6 2 8				
			約定 21/ 3/31 12.				
			J-REIT買入額				
			6, 8 2 3				
			約定 22/ 6/14 12.				
			※直近約1週間の実施分を記載				
			共通担保(全)固定	99,226	CP等買入(推定)	20,700	
			共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	58,200	
			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	27,076	手形売出	0	
			貸出増加支援	790,646	国債売現先	0	
			供給オペ合計	1,069,647	国債補完供給	24,635	
			貸出(推定)	0	国債現(米ドル担保)	0	
			供給額合計	1,069,647	吸収額合計	24,635	
				差し引き	1,045,012		

※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。

<7月4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アウトライイト	
S/N	+0.070	1M	+0.140000	3M	買気配 +0.030
1W	売気配 +0.070	2M	-----	6M	買気配 +0.100
2W	売気配 +0.070	3M	-----	1Y	買気配 +0.200
1M	売気配 +0.070				

<7月3日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	118,968	+3,385
有担保	39,114	+879
無担保	79,854	+2,506

<7月4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	0.050	0.079	0.077	± 0				-----	0.054	+0.007
トムネ				-----				-----	0.044	-0.007
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.050	-0.001
2週間物				-----				-----	0.050	-0.001
3週間物				-----				-----	0.051	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.050	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.085	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.139	± 0
1年物				-----				-----	0.200	± 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