

東京短資デイリーレポート

2024/7/11

<7月10日のマナタリーベース>

6,696,700

<7月11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	5,469,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,443,800
日銀当座預金残高増減前日比	+25,800

<7月11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		+800
財政等要因		-10,200
資金過不足		-9,400
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+12,900
CP等買入		-300
社債等買入		-100
国債補完供給	+21,800	-21,000
金融調節合計		+13,300
当座預金増減-②		+3,900

<7月11日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,447,700
準備預金残高	4,847,400
積み終了先	4,847,300
超過準備	4,847,300
非準備先残高	600,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,944,900
今積み期間所要準備額 (平均)	131,500
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 (%)	86.7
進捗率乖離幅	+13.2

<7月12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		+800
財政等要因		-20,000
資金過不足		-19,200
金融調節確定分		
	期落	新規
社債等買入		-100
国債補完供給	+21,000	
金融調節合計		+20,900
当座預金増減		+1,700

<7月12日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残544兆9,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月12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	5,494,400	+46,700
+40,000	5,489,400	+41,700
+35,000	5,484,400	+36,700
+30,000	5,479,400	+31,700
+25,000	5,474,400	+26,700
+20,000	5,469,400	+21,700
+15,000	5,464,400	+16,700
+10,000	5,459,400	+11,700
+5,000	5,454,400	+6,700
± 0	5,449,400	+1,700
-5,000	5,444,400	-3,300
-10,000	5,439,400	-8,300
-15,000	5,434,400	-13,300
-20,000	5,429,400	-18,300
-25,000	5,424,400	-23,300
-30,000	5,419,400	-28,300
-35,000	5,414,400	-33,300
-40,000	5,409,400	-38,300
-45,000	5,404,400	-43,300

<7月11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。

(10:40) CP買入	24/ 7/17	3,000億	応札 8,404億	落札 2,994億	最低 +0.191%	平均 +0.200%	按分 26.9%
(11:50) 国債補完供給	24/ 7/11-24/ 7/12		応札 21,481億	落札 21,481億	全取 -0.150%	平均 -0.150%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/11-24/ 7/12		応札 41億	落札 41億	全取 -0.150%	平均 -0.150%	

<7月11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	
9 9, 2 2 6	3 1, 1 3 7	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
7/10~ 7/24 8,005.	7/ 4(-1Y) 1,500.	3 1, 5 2 3	8 6 8, 6 5 8	8/19~ 8/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	7/ 4(1-3Y) 3,754.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	7/ 4(3-5Y) 4,255.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	7/ 4(10-25Y) 1,504.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008.	7/11(1-3Y) 3,752.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.	7/11(3-5Y) 4,252.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	7/11(5-10Y) 4,257.	12/ 1~12/ 1 2,464.		11/17~11/17 0.
	7/11(25Y-) 753.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.		2/16~ 2/16 0.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.		
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			7/11~ 7/18 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	
			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	
			2 1, 5 2 2	
			7/11~ 7/12 21,481.	
			7/11~ 7/12 41.	
			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	
			CP買入額(月初末)	
			0	
			(7/17 2,994.)	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			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
			貸出増加支援	790,646
			供給オペ合計	1,069,647
			貸出(推定)	0
			供給額合計	1,069,647
			国債補完供給	21,522
			国債売現先(米ドル担保)	0
			吸収額合計	21,522
			差し引き	1,048,125

※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11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 +0.190000	3M 買気配 +0.020
1W 売気配 +0.070	2M +0.280000	6M 買気配 +0.020
2W 売気配 +0.070	3M +0.275000	1Y 買気配 +0.170
1M 売気配 +0.070		

<7月10日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	113,838	-7,003
有担保	41,142	+98
無担保	72,696	-7,101

<7月11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	0.070	0.079	0.077	± 0					0.079	-0.004
トムネ				-----					0.053	-0.023
スポネ				-----						
1週間物			0.240	+0.165					0.053	-0.002
2週間物	0.140	0.170	0.152	-0.058					0.053	-0.001
3週間物				-----					0.054	-0.002
1ヶ月物				-----					0.055	-0.001
3ヶ月物	0.230	0.240	0.237	-----					0.088	-0.001
6ヶ月物				-----					0.142	± 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