

東京短資デイリーレポート

2024/7/12

<7月11日のマネタリーベース>

6,699,700

<7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	5,449,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,447,700
日銀当座預金残高増減前日比	+1,700

<7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	+900
財政等要因	-20,300
資金過不足	-19,400
金融調節	
社債等買入	-100
国債補完供給	+21,000
金融調節合計	+200
当座預金増減-②	-19,200

<7月12日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,428,500
準備預金残高	4,830,300
積み終了先	4,830,300
超過準備	4,830,300
非準備先残高	598,200

<参考>

翌積み期間所要準備額(積数)	4,082,100
翌積み期間所要準備額(平均)	131,700

<7月16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	+1,100
財政等要因	-31,700
資金過不足	-30,600
金融調節確定分	
CP等買入	-300
国債補完供給	+20,700
金融調節合計	+20,400
当座預金増減	-10,200

<7月16日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆8,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での出合いが中心か。
--

<7月16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	5,463,300	+34,800
+40,000	5,458,300	+29,800
+35,000	5,453,300	+24,800
+30,000	5,448,300	+19,800
+25,000	5,443,300	+14,800
+20,000	5,438,300	+9,800
+15,000	5,433,300	+4,800
+10,000	5,428,300	-200
+5,000	5,423,300	-5,200
±0	5,418,300	-10,200
-5,000	5,413,300	-15,200
-10,000	5,408,300	-20,200
-15,000	5,403,300	-25,200
-20,000	5,398,300	-30,200
-25,000	5,393,300	-35,200
-30,000	5,388,300	-40,200
-35,000	5,383,300	-45,200
-40,000	5,378,300	-50,200
-45,000	5,373,300	-55,200

<7月12日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 7/12-24/ 7/16	応札 21,271億 落札 21,271億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/12-24/ 7/16	応札 0億 落札 0億

<7月12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
99,226	31,137	成長基盤強化支援資金供給	1,001
7/10~ 7/24 8,005.	7/11(1-3Y) 3,752.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	8/19~ 8/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	7/11(3-5Y) 4,252.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	7/11(5-10Y) 4,257.	12/ 2~12/ 2 1,712.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	7/11(25Y-) 753.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.		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.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	2/16~ 2/16 0.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	
			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 16,122百万ドル
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.
			12/ 4~12/ 4 3,325.
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.
			6/ 3~ 6/ 3 5,318.
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			国債買入先オペ 0
			国債売先(米ドルオペ用担保) 0
			国債売先オペ 0
			国債買入額(固定利回)(月初来) 0
			国債買入額(固定利回) 0
			CP買入額(月初来) 0
			(7/17 2,994.)
			社債買入額(月初来) 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
			国債補完供給 21,271
			7/12~ 7/16 21,271.
			7/12~ 7/16 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。

<7月12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 +0.185000	3M 買気配 +0.020
1W 売気配 +0.070	2M -----	6M 買気配 +0.050
2W 売気配 +0.070	3M +0.270000	1Y 買気配 +0.180
1M 売気配 +0.070		

<7月11日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,683	+1,845
有担保	40,281	-861
無担保	75,402	+2,706

<7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	0.078	0.077	±0					0.086	+0.007
トムネ				-----					0.080	+0.027
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.057	+0.004
2週間物			0.150	-0.002					0.054	+0.001
3週間物				-----					0.055	+0.001
1ヶ月物			0.190	-----					0.055	±0
3ヶ月物				-----					0.088	±0
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