

東京短資デイリーレポート

2024/7/16

<7月12日のマナリーベース>

6,679,700

<7月16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	5,418,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,428,500
日銀当座預金残高増減前日比	-10,200

<7月16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		+1,000
財政等要因		-29,600
資金過不足		-28,600
金融調節		
CP等買入	期落	新規
	-300	
国債補充供給	+20,700	-22,700
金融調節合計		-2,300
当座預金増減-②		-30,900

<7月16日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,397,600
準備預金残高	4,810,100
積み終了先	3,490,100
超過準備	1,296,900
非準備先残高	587,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,082,100
今積み期間所要準備額(平均)	131,700
残り要積立額(積数)	568,900
残り要積立額(平均)	19,000
準備進捗率(%)	86.0
日数進捗率(%)	3.2
進捗率乖離幅	+82.8

<7月17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		+1,400
財政等要因		-27,400
資金過不足		-26,000
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
	-100	+3,000
国債補充供給	+22,700	
金融調節合計		+25,600
当座預金増減		-400

<7月17日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残539兆7,200億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月17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	5,442,200	+44,600
+40,000	5,437,200	+39,600
+35,000	5,432,200	+34,600
+30,000	5,427,200	+29,600
+25,000	5,422,200	+24,600
+20,000	5,417,200	+19,600
+15,000	5,412,200	+14,600
+10,000	5,407,200	+9,600
+5,000	5,402,200	+4,600
±0	5,397,200	-400
-5,000	5,392,200	-5,400
-10,000	5,387,200	-10,400
-15,000	5,382,200	-15,400
-20,000	5,377,200	-20,400
-25,000	5,372,200	-25,400
-30,000	5,367,200	-30,400
-35,000	5,362,200	-35,400
-40,000	5,357,200	-40,400
-45,000	5,352,200	-45,400

<7月16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) 米ドル資金供給	24/ 7/18-24/ 7/25	応札 3m1l 落札 3m1l	貸付 5.580%
(11:50) 国債補充供給	24/ 7/16-24/ 7/17	応札 23,305億 落札 23,305億 全取 -0.150% 平均 -0.150%	
(13:50) 国債補充供給	24/ 7/16-24/ 7/17	応札 0億 落札 0億	

<7月16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 9,226	3 1,137	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.	貸出増加支援資金供給	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.	
		※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.	
		(7/18~ 7/25 3.)	
		※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 6,122百万ドル	
		9/ 5~ 9/ 5 5,382.	
		12/ 4~12/ 4 3,325.	
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売入先(米ドルオペ用担保)	
		0	
		国債短期証券買入額(月初来)	
		0	
		国債売入先オペ	
		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	
		CP買入額(月初来)	
		0	
		(7/17 2,994.)	
		社債買入額(月初来)	
		0	

<7月16日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,226	CP等買入(推定)	18,700
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	57,700
国債買入先	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	国債売入先	0
供給オペ合計	1,069,647	国債補充供給	23,305
貸出(推定)	0	国債売入先	0
供給額合計	1,069,647	吸収額合計	23,305
		差し引き	1,046,342

※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16日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP優先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	最低	最高	最低	最高	最低	最高
+0.070	1M	+0.223000	3M	買気配 +0.020		
1W 売気配 +0.070	2M	+0.260000	6M	買気配 +0.050		
2W 売気配 +0.070	3M	0.000000	1Y	買気配 +0.050		
1M 売気配 +0.070						

<7月12日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	114,954	-729
有担保	39,757	-524
無担保	75,197	-205

<7月16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					0.081	-0.005
トムネ				-----					0.052	-0.028
スポネ				-----						
1週間物	0.150	0.175	0.167	-----					0.056	-0.001
2週間物	0.110	0.300	0.149	-0.001					0.055	+0.001
3週間物			0.130	-----					0.055	±0
1ヶ月物				-----					0.056	+0.001
3ヶ月物	0.210	0.290	0.260	-----					0.089	+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