

東京短資デイリーレポート

2024/7/17

<7月16日のマナタリーベース>

6,647,700

<7月17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	5,397,200
前日の日銀当座預金残高①	5,397,600
日銀当座預金残高増減前日比	-400

<7月17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		+1,500
財政等要因		-23,500
資金過不足		-22,000
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	+3,000
国債補充供給	+22,700	-25,600
金融調節合計		± 0
当座預金増減②		-22,000

<7月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,375,600
準備預金残高	4,785,300
積み終了先	4,712,900
超過準備	4,298,800
非準備先残高	590,300

<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)	82,500
残り要積立額(平均)	2,800
準備進捗率(%)	97.9
日数進捗率(%)	6.5
進捗率乖離幅	+91.4

<7月18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		+700
財政等要因		+9,000
資金過不足		+9,700
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+9,600
CP等買入	-100	
国債補充供給	+25,600	
金融調節合計		+35,100
当座預金増減		+44,800

<7月18日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残542兆400億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月18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	5,465,400	+89,800
+40,000	5,460,400	+84,800
+35,000	5,455,400	+79,800
+30,000	5,450,400	+74,800
+25,000	5,445,400	+69,800
+20,000	5,440,400	+64,800
+15,000	5,435,400	+59,800
+10,000	5,430,400	+54,800
+5,000	5,425,400	+49,800
± 0	5,420,400	+44,800
-5,000	5,415,400	+39,800
-10,000	5,410,400	+34,800
-15,000	5,405,400	+29,800
-20,000	5,400,400	+24,800
-25,000	5,395,400	+19,800
-30,000	5,390,400	+14,800
-35,000	5,385,400	+9,800
-40,000	5,380,400	+4,800
-45,000	5,375,400	-200

<7月17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。

(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	24/ 7/18	3,750億 応札 12,722億 落札 3,755億 最低 -0.009% 平均 -0.008% 按分 90.1%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 7/18	4,250億 応札 7,590億 落札 4,257億 最低 -0.015% 平均 -0.012% 按分 56.8%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 7/18	1,500億 応札 2,075億 落札 1,501億 最低 -0.014% 平均 -0.008% 按分 86.3%
(11:50) 国債補充供給	24/ 7/17-24/ 7/18	応札 26,309億 落札 26,309億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補充供給	24/ 7/17-24/ 7/18	応札 0億 落札 0億

<7月17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 9,226	3 1,137	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
		1 6,122 百万ドル	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.	(7/18(1-3Y) 3,755.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.
1/16~ 1/16 20,009.	(7/18(5-10Y) 4,257.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	(7/18(10-25Y) 1,501.)	12/ 1~12/ 1 2,464.	8/18~ 8/18 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	11/17~11/17 0.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	2/16~ 2/16 0.
			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
			※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
			国債補充供給
			2 6,309
			7/17~ 7/18 26,309.
			7/17~ 7/18 0.
			ETF買入額
			3 56,921
			約定 23/10/ 4 701.
			ETF買入額(企業支援)
			1 4,628
			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)
			2,994
			7/17 2,994.
			社債買入額(月初末)
			0
			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
			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
			国債補充供給
			26,309
			貸出(推定)
			0
			国売現(米ドル担保)
			0
			供給額合計
			1,069,647
			吸収額合計
			26,309
			差し引き
			1,043,338

※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17日のオープン市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP買現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
S/N	+0.070	1M	+0.185000	3M	買気配 +0.030
1W	売気配 +0.070	2M	-----	6M	買気配 +0.050
2W	売気配 +0.070	3M	+0.275000	1Y	買気配 +0.200
1M	売気配 +0.070				

<7月16日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	118,547	+3,593
有担保	39,573	-184
無担保	78,974	+3,777

<7月17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	0.078	+0.001				-----	0.079	-0.002
トムネ				-----				-----	0.041	-0.011
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.075	0.175	0.082	-0.085				-----	0.051	-0.005
2週間物			0.180	+0.031				-----	0.053	-0.002
3週間物				-----				-----	0.055	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.056	± 0
3ヶ月物				-----				-----	0.089	± 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