

東京短資デイリーレポート

2024/7/18

<7月17日のマナリーベース>

6,624,300

<7月18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	5,420,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,375,600
日銀当座預金残高増減前日比	+44,800

<7月18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	+7,100
資金過不足	+7,900
金融調節	
国債買入	期落 新規
CP等買入	-100
国債補完供給	+25,600 -23,300
金融調節合計	+11,800
当座預金増減-②	+19,700

<7月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,395,300
準備預金残高	4,805,100
積み終了先	4,770,900
超過準備	4,757,300
非準備先残高	590,200

<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)	34,700
残り要積立額 (平均)	1,200
準備進捗率(%)	99.1
日数進捗率(%)	9.7
進捗率乖離幅	+89.4

<7月19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	+1,200
財政等要因	+5,900
資金過不足	+7,100
金融調節確定分	
CP等買入	期落 新規
社債等買入	-200
気候変動対応支援	-34,400 +72,400
国債補完供給	+23,300
金融調節合計	+60,600
当座預金増減	+67,700

<7月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆3,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月19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	5,508,000	+112,700
+40,000	5,503,000	+107,700
+35,000	5,498,000	+102,700
+30,000	5,493,000	+97,700
+25,000	5,488,000	+92,700
+20,000	5,483,000	+87,700
+15,000	5,478,000	+82,700
+10,000	5,473,000	+77,700
+5,000	5,468,000	+72,700
± 0	5,463,000	+67,700
-5,000	5,458,000	+62,700
-10,000	5,453,000	+57,700
-15,000	5,448,000	+52,700
-20,000	5,443,000	+47,700
-25,000	5,438,000	+42,700
-30,000	5,433,000	+37,700
-35,000	5,428,000	+32,700
-40,000	5,423,000	+27,700
-45,000	5,418,000	+22,700

<7月18日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 7/18-24/ 7/19	応札 23,848億 落札 23,848億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/18-24/ 7/19	応札 6億 落札 6億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(9:30) 気候変動対応支援	24/ 7/19-25/ 7/18	応札 72,361億 落札 72,361億 貸付 0.000%

<7月18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	4 0, 6 5 0	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			
7/10~ 7/24	8,005.	7/11(1-3Y)	3,752.	3 1, 5 2 3	8 6 8, 6 5 8	8/19~ 8/19	381.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	7/11(3-5Y)	4,252.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/11(5-10Y)	4,257.	12/ 2~12/ 2	1,712.	12/15~12/13	54,701.
1/10~ 1/10	20,011.	7/11(25Y-)	753.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	3/17~ 3/17	64,498.
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.	11/17~11/17	0.
1/19~ 1/20	1,163.	7/18(10-25Y)	1,501.	12/ 1~12/ 1	2,464.	2/16~ 2/16	0.
				3/ 2~ 3/ 2	7,922.	※直近約1年分の期落ち分を記載	
				6/ 3~ 6/ 3	3,160.	米ドル資金供給オペ	
						3百万ドル	
						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, 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 3, 8 5 4	
						7/18~ 7/19 23,848.	
						7/18~ 7/19 6.	
						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	
						C P 買入額(月初末)	
						2, 9 9 4	
						7/17 2,994.	
						社債買入額(月初末)	
						0	
						C P 買入額(推定) 21,500	
						社債等買入(推定) 57,700	
						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 23,854	
						貸出(推定) 0	
						国債売現先(米ドル担保) 0	
						供給額合計 1,069,647	
						吸収額合計 23,854	
						差し引き 1,045,793	

※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18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	+0.170000	3M	買気配 +0.050
1W	売気配 +0.070	2M	+0.140000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.070	3M	-----	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.070				

<7月17日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,095	+1,548
有担保	39,297	-276
無担保	80,798	+1,824

<7月18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	0.079	0.077	-0.001				-----	0.033	-0.046
トムネ				-----				-----	-0.033	-0.074
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.150	+0.068				-----	0.044	-0.007
2週間物			0.160	-0.020				-----	0.049	-0.004
3週間物				-----				-----	0.053	-0.002
1ヶ月物	0.150	0.215	0.172	-----				-----	0.055	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.090	+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