

東京短資デイリーレポート

2024/7/23

<7月22日のマネタリーベース>

6,699,000

<7月23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	5,471,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,452,900
日銀当座預金残高増減前日比	+18,100

<7月23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		+700
財政等要因		-3,000
資金過不足		-2,300
金融調節		
国債補完供給	+23,600	-20,800
金融調節合計		+2,800
当座預金増減-②		+500

<7月23日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,453,400
準備預金残高	4,883,300
積み終了先	4,881,800
超過準備	4,881,500
非準備先残高	570,100

<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)	7,400
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	25.8
進捗率乖離幅	+74.0

<7月24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		0
財政等要因		+2,100
資金過不足		+2,100
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
国債買入		+12,200
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
CP等買入		-200
社債等買入		+800
国債補完供給	+20,800	
金融調節合計		+33,600
当座預金増減		+35,700

<7月24日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆9,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月24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	5,534,100	+80,700
+40,000	5,529,100	+75,700
+35,000	5,524,100	+70,700
+30,000	5,519,100	+65,700
+25,000	5,514,100	+60,700
+20,000	5,509,100	+55,700
+15,000	5,504,100	+50,700
+10,000	5,499,100	+45,700
+5,000	5,494,100	+40,700
± 0	5,489,100	+35,700
-5,000	5,484,100	+30,700
-10,000	5,479,100	+25,700
-15,000	5,474,100	+20,700
-20,000	5,469,100	+15,700
-25,000	5,464,100	+10,700
-30,000	5,459,100	+5,700
-35,000	5,454,100	+700
-40,000	5,449,100	-4,300
-45,000	5,444,100	-9,300

<7月23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/ 7/24	3,750億	応札 11,810億	落札 3,754億	最低 +0.011%	平均 +0.012%	按分 45.9%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 7/24	4,250億	応札 9,264億	落札 4,255億	最低 +0.011%	平均 +0.013%	按分 97.5%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 7/24	4,250億	応札 10,445億	落札 4,255億	最低 +0.015%	平均 +0.016%	按分 55.5%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 7/25-24/ 8/ 1		応札 1ml	落札 1ml		貸付 5.580%	
(11:50) 国債補完供給	24/ 7/23-24/ 7/24		応札 21,407億	落札 21,407億	全取 -0.150%	平均 -0.150%	
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 7/24-24/ 8/ 7	8,000億	応札 12,211億	落札 8,007億		貸付 0.100%	按分 65.6%
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/23-24/ 7/24		応札 17億	落札 17億	全取 -0.150%	平均 -0.150%	
(14:45) ミドルオペ用担保供給	24/ 7/24-24/ 8/ 2	5,000億	応札 2億	落札 2億		平均 0.000%	

<7月23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	4 0,650	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.	7/18(1-3Y) 3,755.	3 1,523	8 68,658	8/19~ 8/19 381.
(7/24~ 8/ 7 8,007.)	7/18(5-10Y) 4,257.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 20,016.	7/18(10-25Y) 1,501.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	(7/24(1-3Y) 3,754.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.	(7/24(3-5Y) 4,255.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.	(7/24(5-10Y) 4,255.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		8/18~ 8/18 0.
1/16~ 1/16 20,009.		12/ 1~12/ 1 2,464.		11/17~11/17 0.
1/19~ 1/20 1,163.		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	
			3百万ドル	
			7/18~ 7/25 3.	
			(7/25~ 8/ 1 1.)	
			※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
				(7/24~ 8/ 2 2.)
				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 1,424
				7/23~ 7/24 21,407.
				7/23~ 7/24 17.
				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
				(7/24 750.)
				<7月23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) 21,200
				共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 57,000
				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 119,626
				成長基盤支援 27,076 手形売切 0
				貸出増加支援 790,646 国債売現先 0
				供給オペ合計 1,107,610 国債補完供給 21,424
				貸出(推定) 0 国債売現先(米ドル担保) 0
				供給額合計 1,107,610 吸収額合計 21,424
				差し引き 1,086,186

※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23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 +0.050
1W 売気配 +0.070	2M +0.255000	6M 買気配 +0.050
2W 売気配 +0.070	3M -----	1Y 買気配 +0.180
1M 売気配 +0.070		

<7月22日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,253	+117
有担保	39,023	+6
無担保	81,230	+111

<7月23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	0.055	0.125	0.080	-0.003					0.073	-0.019
トムネ			0.125	-----					0.062	-0.019
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.054	-0.001
2週間物				-----					0.054	-0.002
3週間物				-----					0.057	+0.001
1ヶ月物			0.165	-----					0.059	+0.001
3ヶ月物				-----					0.088	± 0
6ヶ月物				-----					0.143	± 0
1年物				-----					0.202	+0.002

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