

東京短資デイリーレポート

2024/7/26

<7月25日のマネタリーベース>

6,715,000

<7月26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	5,499,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,469,100
日銀当座預金残高増減前日比	+30,700

<7月26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		-100
財政等要因		+9,900
資金過不足		+9,800
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-600	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+20,100	-18,400
金融調節合計		+1,000
当座預金増減-②		+10,800

<7月26日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,479,900
準備預金残高	4,884,600
積み終了先	4,883,800
超過準備	4,883,700
非準備先残高	595,300

<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)	2,200
残り要積立額 (平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+58.0

<7月29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		+200
財政等要因		+6,300
資金過不足		+6,500
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-500	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+18,400	
金融調節合計		+17,800
当座預金増減		+24,300

<7月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残550兆4,200億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月29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	5,549,200	+69,300
+40,000	5,544,200	+64,300
+35,000	5,539,200	+59,300
+30,000	5,534,200	+54,300
+25,000	5,529,200	+49,300
+20,000	5,524,200	+44,300
+15,000	5,519,200	+39,300
+10,000	5,514,200	+34,300
+5,000	5,509,200	+29,300
±0	5,504,200	+24,300
-5,000	5,499,200	+19,300
-10,000	5,494,200	+14,300
-15,000	5,489,200	+9,300
-20,000	5,484,200	+4,300
-25,000	5,479,200	-700
-30,000	5,474,200	-5,700
-35,000	5,469,200	-10,700
-40,000	5,464,200	-15,700
-45,000	5,459,200	-20,700

<7月26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) CP買入	24/ 7/31	3,000億	応札 7,368億	落札 2,990億	全取 +0.226%	平均 +0.246%
(11:50) 国債補完供給	24/ 7/26-24/ 7/29		応札 18,965億	落札 18,965億	全取 -0.250%	平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/26-24/ 7/29		応札 50億	落札 50億	全取 -0.250%	平均 -0.250%

<7月26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)	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
99,228	52,914			1,001
7/24~ 8/ 7 8,007.	7/24(1-3Y) 3,754.	31,523	868,658	8/19~ 8/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	7/24(3-5Y) 4,255.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	7/24(5-10Y) 4,255.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	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	
			1百万ドル	
			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	
			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.	
			国債買現先オペ	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			2	
			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	
			19,015	
			7/26~ 7/29 18,965.	
			7/26~ 7/29 50.	
			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	
			CP買入額(月初末)	
			2,994	
			7/17 2,994.	
			(7/31 2,990.)	
			社債買入額(月初末)	
			750	
			7/24 750.	
			<7月26日 日銀信用概算(除く買切)>	
			共通担保(全)固定 99,228	CP等買入(推定) 20,300
			共通担保(全)金入 70,035	社債等買入(推定) 57,300
			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 1,107,612	国債補完供給 19,015
			貸出(推定) 0	国債売現先(米ドル担保) 2
			供給額合計 1,107,612	吸収額合計 19,017
			差し引き 1,088,595	

※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26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 +0.200000	3M 買気配 +0.050
1W 売気配 +0.070	2M +0.260000	6M 買気配 +0.050
2W 売気配 +0.070	3M -----	1Y 買気配 +0.050
1M 売気配 +0.070		

<7月25日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,193	-576
有担保	37,144	-819
無担保	78,049	+243

<7月26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	0.078	0.078	-0.003					0.079	+0.014
トムネ				-----					0.078	+0.045
スポネ				-----						
1週間物			0.230	-0.010					0.067	+0.018
2週間物			0.180	+0.005					0.070	+0.014
3週間物				-----					0.071	+0.013
1ヶ月物				-----					0.080	+0.011
3ヶ月物			0.210	-----					0.108	+0.012
6ヶ月物				-----					0.153	+0.006
1年物				-----					0.209	+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