

東京短資デイリーレポート

2024/7/29

<7月26日のマネタリーベース>

6,725,900

<7月29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	5,504,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,479,900
日銀当座預金残高増減前日比	+24,300

<7月29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	+200
財政等要因	+2,900
資金過不足	+3,100
金融調節	
CP等買入	-500
社債等買入	-100
国債補充供給	+18,400
金融調節合計	-2,700
当座預金増減-②	+400

<7月29日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,480,300
準備預金残高	4,901,700
積み終了先	4,900,900
超過準備	4,900,900
非準備先残高	578,600

<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)	1,400
残り要積立額 (平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	45.2
進捗率乖離幅	+54.7

<7月30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	-400
財政等要因	+4,900
資金過不足	+4,500
金融調節確定分	
国債買入	+11,500
CP等買入	-100
国債補充供給	+20,500
金融調節合計	+31,900
当座預金増減	+36,400

<7月30日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆6,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月30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	5,561,700	+81,400
+40,000	5,556,700	+76,400
+35,000	5,551,700	+71,400
+30,000	5,546,700	+66,400
+25,000	5,541,700	+61,400
+20,000	5,536,700	+56,400
+15,000	5,531,700	+51,400
+10,000	5,526,700	+46,400
+5,000	5,521,700	+41,400
±0	5,516,700	+36,400
-5,000	5,511,700	+31,400
-10,000	5,506,700	+26,400
-15,000	5,501,700	+21,400
-20,000	5,496,700	+16,400
-25,000	5,491,700	+11,400
-30,000	5,486,700	+6,400
-35,000	5,481,700	+1,400
-40,000	5,476,700	-3,600
-45,000	5,471,700	-8,600

<7月29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(3Y-5Y)	24/ 7/30	4,250億 応札 9,453億 落札 4,255億 最低 -0.022% 平均 -0.019% 按分 39.3%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 7/30	4,250億 応札 8,010億 落札 4,255億 最低 -0.024% 平均 -0.022% 按分 30.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 7/30	1,500億 応札 3,279億 落札 1,502億 最低 -0.022% 平均 -0.019% 按分 10.9%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/ 7/30	750億 応札 2,268億 落札 752億 最低 -0.018% 平均 -0.017% 按分 73.0%
(10:10) 国債買入(物国)	24/ 7/30	600億 応札 1,997億 落札 600億 按分+0.440円 平均+0.219円 按分 23.4%
(11:50) 国債補充供給	24/ 7/29-24/ 7/30	応札 21,135億 落札 21,135億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補充供給	24/ 7/29-24/ 7/30	応札 0億 落札 0億

<7月29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								
9,922.8	52,914	31,523	868,658	1,001								
7/24~ 8/ 7	8,007.	7/24(1-3Y)	3,754.	8/19~ 8/19	381.							
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	7/24(3-5Y)	4,255.	9/16~ 9/13	132,310.							
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/24(5-10Y)	4,255.	12/15~12/13	54,701.							
1/10~ 1/10	20,011.	(7/30(3-5Y)	4,255.)	3/17~ 3/17	64,498.							
1/13~ 1/14	20,008.	(7/30(5-10Y)	4,255.)	6/18~ 6/18	26,498.							
1/16~ 1/16	20,009.	(7/30(10-25Y)	1,502.)	9/ 1~ 9/ 1	5,024.							
1/19~ 1/20	1,163.	(7/30(25Y-) 752.)	(7/30(物国) 600.)	12/ 1~12/ 1	2,464.							
				3/ 2~ 3/ 2	7,922.							
				6/ 3~ 6/ 3	3,160.							
					※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							
					国債補充供給							
					21,135							
					7/29~ 7/30	21,135.						
					7/29~ 7/30	0.						
					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.						
					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29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	+0.285000	3M	買気配 +0.100		
					1W	売気配 +0.070	2M	+0.272000	6M	買気配 +0.100		
					2W	売気配 +0.070	3M	+0.300000	1Y	買気配 +0.180		
					1M	売気配 +0.070						
					<7月29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	平均値	前日比		
					翌日物	0.070	0.078	0.077	-0.001	-----	0.081	+0.002
					トムネ				-----	0.074	-0.004	
					スポネ				-----			
					1週間物	0.078	0.250	0.081	-0.149	-----	0.074	+0.007
					2週間物				-----	0.077	+0.007	
					3週間物				-----	0.079	+0.008	
					1ヶ月物				-----	0.090	+0.010	
					3ヶ月物				-----	0.115	+0.007	
					6ヶ月物				-----	0.155	+0.002	
					1年物				-----	0.211	+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