

東京短資デイリーレポート

2024/8/8

<8月7日のマナリーベース>

6,668,000

<8月8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	5,453,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,423,100
日銀当座預金残高増減前日比	+30,300

<8月8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	-500	
財政等要因	-1,500	
資金過不足	-2,000	
金融調節		
国債買入	期落	新規
CP等買入	-200	
国債補完供給	+22,100	-23,000
金融調節合計		+7,300
当座預金増減-②		+5,300

<8月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,428,400
準備預金残高	4,853,100
積み終了先	4,853,000
超過準備	4,853,000
非準備先残高	575,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,075,700
今積み期間所要準備額 (平均)	131,500
残り要積立額 (積数)	200
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	77.4
進捗率乖離幅	+22.5

<8月9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	-300	
財政等要因	-11,000	
資金過不足	-11,300	
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
国債補完供給	+23,000	
金融調節合計		+22,300
当座預金増減		+11,000

<8月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残543兆9,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.225%~+0.228% での合いが中心か。

<8月9日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,484,400	+56,000
+40,000	5,479,400	+51,000
+35,000	5,474,400	+46,000
+30,000	5,469,400	+41,000
+25,000	5,464,400	+36,000
+20,000	5,459,400	+31,000
+15,000	5,454,400	+26,000
+10,000	5,449,400	+21,000
+5,000	5,444,400	+16,000
± 0	5,439,400	+11,000
-5,000	5,434,400	+6,000
-10,000	5,429,400	+1,000
-15,000	5,424,400	-4,000
-20,000	5,419,400	-9,000
-25,000	5,414,400	-14,000
-30,000	5,409,400	-19,000
-35,000	5,404,400	-24,000
-40,000	5,399,400	-29,000
-45,000	5,394,400	-34,000

<8月8日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 8/ 8-24/ 8/ 9	応札 23,471億 落札 23,471億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	24/ 8/ 8-24/ 8/ 9	応札 15億 落札 15億 全取 -0.050% 平均 -0.050%

<8月8日 各オペ残高と内訳>

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初来)	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		
99,225	21,518	成長基盤強化支援資金供給	1,001		
8/ 7~ 8/21 8,004.	8/ 5(-1Y) 1,501.	31,523	868,658	8/19~ 8/19 381.	
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	8/ 5(1-3Y) 3,501.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	8/ 5(3-5Y) 3,754.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.	
1/10~ 1/10 20,011.	8/ 5(5-10Y) 4,007.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.	
1/13~ 1/14 20,008.	8/ 8(1-3Y) 3,502.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12 181.	
1/16~ 1/16 20,009.	8/ 8(3-5Y) 3,752.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		8/18~ 8/18 0.	
1/19~ 1/20 1,163.	8/ 8(10-25Y) 1,501.	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		
			0百万ドル		
			8/ 8~ 8/15 0.		
			※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)		
			0		
			国庫短期証券買入額(月初来)		
			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)(月初来)		
			0		
			国債補完供給		
			23,486		
			8/ 8~ 8/ 9 23,471.		
			8/ 8~ 8/ 9 15.		
			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		
			C P買入額(月初来)		
			0		
			社債買入額(月初来)		
			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		
			119,626		
			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	1,107,609	国債補完供給 23,486
			貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保) 0
			供給額合計	1,107,609	吸収額合計 23,486
			差し引き	1,084,123	

※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。

<8月8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 売気配 +0.200	1M +0.325000	3M 買気配 +0.100	
1W 売気配 +0.200	2M +0.360000	6M 買気配 +0.200	
2W 売気配 +0.200	3M +0.390000	1Y 買気配 +0.200	
1M 売気配 +0.200			

<8月7日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	121,681	+2,132
有担保	36,491	+383
無担保	85,190	+1,749

<8月8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	0.215	0.229	0.227	± 0					0.216	+0.003
トムネ				-----					0.174	+0.023
スポネ				-----						
1週間物			0.350	+0.114					0.162	+0.008
2週間物			0.300	-0.028					0.167	+0.003
3週間物				-----					0.172	± 0
1ヶ月物				-----					0.177	+0.001
3ヶ月物	0.330	0.730	0.387	+0.037					0.201	± 0
6ヶ月物				-----					0.257	+0.003
1年物				-----					0.325	-0.001

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