

<4月3日のマナリーベース>

6,728,500

<4月4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 5,501,300
前日の日銀当座預金残高-① 5,461,500
日銀当座預金残高増減前日比 +39,800

<4月4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 -8,500
資金過不足 -7,700
金融調節
国債補充供給 +50,500 期落 -42,000 新規
金融調節合計 +8,500
当座預金増減-② +800

<4月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②) 5,462,300
準備預金残高 4,760,800
積み終了先 4,760,700
超過準備 4,760,700
非準備先残高 701,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数) 3,909,200
今積み期間所要準備額(平均) 126,100
残り要積立額(積数) 600
残り要積立額(平均) 100
準備進捗率(%) 99.9
日数進捗率(%) 64.5
進捗率乖離幅 +35.4

<4月5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 -25,500
資金過不足 -25,100
金融調節確定分
共通担保(全店) -8,500 期落 +8,300 新規
CP等買入 -100
国債補充供給 +42,700
金融調節合計 +42,400
当座預金増減 +17,300

<4月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残547兆9,600億円)で
無担保コール0/Nは-0.010%~-0.005%
での出合いが中心か。

<4月5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 前日比
残高 増減
+45,000 5,524,600 +62,300
+40,000 5,519,600 +57,300
+35,000 5,514,600 +52,300
+30,000 5,509,600 +47,300
+25,000 5,504,600 +42,300
+20,000 5,499,600 +37,300
+15,000 5,494,600 +32,300
+10,000 5,489,600 +27,300
+5,000 5,484,600 +22,300
± 0 5,479,600 +17,300
-5,000 5,474,600 +12,300
-10,000 5,469,600 +7,300
-15,000 5,464,600 +2,300
-20,000 5,459,600 -2,700
-25,000 5,454,600 -7,700
-30,000 5,449,600 -12,700
-35,000 5,444,600 -17,700
-40,000 5,439,600 -22,700
-45,000 5,434,600 -27,700

<4月4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(国)(5Y-10Y) 23/ 4/ 5 応札 0億 落札 0億 固定利回較差 +0.135%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y) 23/ 4/ 5 応札 0億 落札 0億 固定利回較差 +0.230%
(10:40) ミドル資金供給 23/ 4/ 6-23/ 4/13 応札 0mil 落札 0mil 貸付 5.070%
(11:50) 国債補充供給 23/ 4/ 4-23/ 4/ 5 応札 1,378億 落札 1,378億 全取 -1.100% 平均 -1.773%
(11:50) 国債補充供給 23/ 4/ 4-23/ 4/ 5 応札 40,586億 落札 40,586億 全取 -0.350% 平均 -0.352%
(13:00) 共通担保(全)国 23/ 4/ 5-23/ 4/19 応札 8,255億 落札 8,255億 貸付 0.000%
(13:50) 国債補充供給 23/ 4/ 4-23/ 4/ 5 応札 0億 落札 0億

<4月4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
9 9 7 2 2 0 成長基盤強化支援資金供給 貸出増加支援資金供給 1,716
1/ 5~ 1/ 6 10,016. 3/30(3-5Y) 5,007. 5 2, 2 0 0 7 2 2, 7 8 6 5/14~ 5/12 300.
1/ 6~ 1/ 6 20,014. 3/30(5-10Y) 5,760. 6/ 4~ 6/ 2 4,312. 6/19~ 6/19 28,033. 6/11~ 5/12 596.
1/10~ 1/10 20,011. 3/30(10-25Y) 2,005. 6/ 5~ 6/ 5 5. 9/17~ 9/15 13,014. 8/20~ 8/18 0.
1/13~ 1/14 20,008. 3/30(物国) 601. 9/ 3~ 9/ 1 1,940. 12/16~12/15 20,601. 11/19~11/17 0.
1/16~ 1/16 20,009. 9/ 4~ 9/ 4 34. 3/18~ 3/18 41,458. 2/18~ 2/16 0.
1/19~ 1/20 1,163. 12/ 4~12/ 4 10,258. 6/ 3~ 3/ 4 2,178. ※直近約1年分の期落ち分を記載 5/17~ 5/17 0.
3/22~ 4/ 5 8,501. 3/ 4~ 6/ 3 1,950. 米ドル資金供給オペ 8/19~ 8/19 381.
(4/ 5~ 4/19 8,255.) 9/ 2~ 9/ 2 1,804. 0百万ドル 11/18~11/18 93.
3/29~ 4/ 5 0.
3/30~ 4/ 6 0.
成長基盤強化支援米ドル特別 3/31~ 4/ 7 0.
1 7, 7 0 9 百万ドル 4/ 3~ 4/10 0.
6/ 3~ 6/ 2 5,848. 4/ 4~ 4/11 0.
9/ 2~ 9/ 5 6,101. (4/ 5~ 4/12 0.)
12/ 2~12/ 4 3,607. (4/ 6~ 4/13 0.)
3/ 3~ 3/ 4 2,153.
国債買現先オペ 0
0
新型コロナ企業金融支援 5 9, 8 1 0
1/27~ 4/27 2,514.
2/28~ 5/26 5,355.
3/31~ 6/30 51,941.
国債売現先オペ 0
0
※直近約1週間の実施分を記載
※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)
国庫短期証券買入額(月初来) 0
0
C P買入額(月初来) 0
0
ETF買入額 3 5 6, 2 2 0
約定 23/ 3/14 701.
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

<4月4日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定 99,722 CP等買入(推定) 21,000
国債買現先 0 社債等買入(推定) 80,200
被災地金融機関支援 1,716
気候変動対応支援 44,214
成長基盤強化支援 47,971
貸出増加支援 650,943 手形売出 0
新型コロナ企業金融支援 59,810 国債売現先 0
供給オペ合計 904,376 国債補充供給 41,964
貸出(推定) 0 国債売現先(米ドル担保) 0
供給額合計 904,376 吸収額合計 41,964
差し引き 862,412

※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。

<4月4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 0.000 1M ----- 3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020 2M ----- 6M 買気配 -0.100
2W 売気配 -0.020 3M ----- 1Y 買気配 -0.030
1M 売気配 -0.020

<4月3日のコール市場残高(単位:億円)>

残高 増減
市場合計 185,053 +46,471
有担保 28,842 +8,037
無担保 156,211 +38,434

<4月4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 0.001 -0.008 +0.001 ----- -0.099 +0.031
トムネ ----- -0.107 +0.030
スポネ 0.001 -----
1週間物 -0.040 -0.005 -0.037 -0.027 ----- -0.138 +0.003
2週間物 -0.025 -0.015 -0.021 -0.010 ----- -0.142 +0.004
3週間物 ----- -0.148 +0.004
1ヶ月物 0.001 0.230 0.083 +0.090 ----- -0.163 +0.004
3ヶ月物 0.150 0.180 0.155 +0.155 ----- -0.170 +0.004
6ヶ月物 ----- -0.127 +0.001
1年物 ----- -0.098 ± 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。
非市場債券(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