

東京短資デイリーレポート

2023/4/6

<4月5日のマナリーベース>

6,711,100

<4月6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	5,492,300
前日の日銀当座預金残高(①)	5,445,300
日銀当座預金残高増減前日比	+47,000

<4月6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		+2,800
資金過不足		+2,700
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+13,200
国庫短期証券買入		+1,000
国債補充供給	+34,400	-36,500
金融調節合計		+12,100
当座預金増減(②)		+14,800

<4月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,460,100
準備預金残高	4,768,900
積み終了先	4,768,800
超過準備	4,768,800
非準備先残高	691,200

<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)	400
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	71.0
進捗率乖離幅	+28.9

<4月7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		+1,200
財政等要因		-6,800
資金過不足		-5,600
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入		-200
国債補充供給	+37,100	
金融調節合計		+36,900
当座預金増減		+31,300

<4月7日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残549兆1,400億円)で 無担保コール0/Nは-0.010%~-0.005% での合いが中心か。

<4月7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	5,536,400	+76,300
+40,000	5,531,400	+71,300
+35,000	5,526,400	+66,300
+30,000	5,521,400	+61,300
+25,000	5,516,400	+56,300
+20,000	5,511,400	+51,300
+15,000	5,506,400	+46,300
+10,000	5,501,400	+41,300
+5,000	5,496,400	+36,300
± 0	5,491,400	+31,300
-5,000	5,486,400	+26,300
-10,000	5,481,400	+21,300
-15,000	5,476,400	+16,300
-20,000	5,471,400	+11,300
-25,000	5,466,400	+6,300
-30,000	5,461,400	+1,300
-35,000	5,456,400	-3,700
-40,000	5,451,400	-8,700
-45,000	5,446,400	-13,700

<4月6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/ 7	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.035%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 4/ 7	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.205%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 4/10-23/ 4/17	応札	0m1	落札	0m1	貸付	5.070%
(11:50) 国債補充供給	23/ 4/ 6-23/ 4/ 7	応札	718億	落札	718億	全取	-1.100% 平均 -2.048%
(11:50) 国債補充供給	23/ 4/ 6-23/ 4/ 7	応札	35,805億	落札	35,805億	全取	-0.350% 平均 -0.352%
(13:50) 国債補充供給	23/ 4/ 6-23/ 4/ 7	応札	0億	落札	0億		

<4月6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
99,476	13,271	成長基盤強化支援資金供給	1,716
		貸出増加支援資金供給	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	3/30(3-5Y) 5,007.	52,200	722,786
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	3/30(5-10Y) 5,760.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.
1/10~ 1/10 20,011.	3/30(10-25Y) 2,005.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.
1/13~ 1/14 20,008.	3/30(物国) 601.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.
1/16~ 1/16 20,009.	4/ 6(-1Y) 1,501.	9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.
1/19~ 1/20 1,163.	4/ 6(1-3Y) 4,257.	12/ 4~12/ 4 10,258.	
4/ 5~ 4/19 8,255.	4/ 6(3-5Y) 5,004.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	
	4/ 6(10-25Y) 2,509.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	
		9/ 2~ 9/ 2 1,804.	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	
		米ドル資金供給オペ	
		1,7709百万ドル	
		6/ 3~ 6/ 2 5,848.	
		9/ 2~ 9/ 5 6,101.	
		12/ 2~12/ 4 3,607.	
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
		※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	
		4/ 4~ 4/11 0.	
		4/ 5~ 4/12 0.	
		4/ 6~ 4/13 0.	
		(4/ 7~ 4/14 0.)	
		(4/10~ 4/17 0.)	
		国債買現先オペ	
		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	
		CP買入額(月初末)	
		0	
		ETF買入額	
		356,220	
		約定 23/ 3/14 701.	
		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	
		社債買入額(月初末)	
		0	
		社債買入額(月初末)	
		0	
		貸出増加支援	
		650,943	手形売出
		59,810	国債売現先
		904,130	国債補充供給
		0	貸出(推定)
		904,130	国債売現先
		0	貸出(推定)
		904,130	吸収額合計
			867,607

※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6日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先	CPプライマリー	TBアウトライト
	0.000	1M +0.010000	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5日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	191,006	+3,901
有担保	30,460	-464
無担保	160,546	+4,365

<4月6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	-0.006	+0.001				-----	-0.110	-0.012
トムネ				-----				-----	-0.131	-0.020
スポネ			0.001	± 0				-----		
1週間物	-0.040	-0.018	-0.039	-0.035				-----	-0.148	-0.011
2週間物	-0.018	-0.002	-0.013	-----				-----	-0.157	-0.015
3週間物				-----				-----	-0.159	-0.009
1ヶ月物			0.050	-----				-----	-0.175	-0.009
3ヶ月物				-----				-----	-0.174	-0.005
6ヶ月物				-----				-----	-0.129	-0.002
1年物				-----				-----	-0.099	-0.001

本資料は情報提供を目的とした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(登金)第524号 加入協会: 日本証券業協会