京短資テイリーレポート

2023/4/19

<4月18日のマネタリーベース>

6,788,500

<4月19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	高 5,556,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,524,700
日銀当座預金残高増減前日上	上 +32,000

<4月19日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

	資金需給実績									
	財政等要因			-7,300						
	資金過不足			-7,800						
-	金融調節									
		期	落	新規						
	国庫短期証券買入			+1,000						
	共通担保(全店)	-8	,300	+10,900						
	社債等買入		-300							

+37,300 -29,400

+11,200 +3,400

<4月19日の日銀当座預金状況>

国債補完供給

金融調節合計 当座預金増減-②

	~"儿子日少日纵马生沉坐你心	
ſ	当座預金残高(①+②)	5,528,100
ı	準備預金残高	4,817,700
ı	積み終了先	4,809,100
ı	超過準備	4,807,900
ı	非準預先残高	710,400

く参老>

139, 300
120 200
128,200
36,700
1,400
99.0
13.3
+85.7

<4月20日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

> 7万20日97日戦コ圧沢亚省勝安国こ亚隊剛即/							
Π	資金需給予想						
	銀行券要因			-1,300			
ш	財政等要因			+3,900			
ш	資金過不足			+2,600			
	金融調節確定分						
		期	落	新規			
ш	CP等買入		-200				
ш	国債補完供給	+29	,400				
	金融調節合計			+29,200			
	当座預金増減			+31,800			

∠4日20日のオペネ相へ

<4月20日のオペア返/
朝一の金融調節はノーオペ
(当預残555兆9,900億円)で
無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005%
での出合いが中心か。

9時20分の 日銀当座 前日比 オペ 預金残高 増減 +45,000 5,604,900 +76,800 +40,000 5,599,900 +71,800 +35,000 5,594,900 +66,800 +30,000 5,589,900 +61,800 +25,000 5,584,900 +56,800 +20,000 5,579,900 +51,800 +10,000 5,574,900 +46,800 +10,000 5,569,900 +41,800 +5,000 5,564,900 +36,800 ± 0 5,559,900 +31,800 -5,000 5,54,900 +26,800 -10,000 5,544,900 +21,800 -15,000 5,544,900 +21,800 -20,000 5,539,900 +11,800 -25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200 -40,000 5,514,900 -8,200 -45,000 5,514,900 -8,200	4月20日9時20分	のオペによる日	銀当座預金状況
+45,000 5,604,900 +76,800 +40,000 5,599,900 +71,800 +35,000 5,594,900 +66,800 +30,000 5,584,900 +61,800 +25,000 5,584,900 +56,800 +20,000 5,579,900 +51,800 +15,000 5,574,900 +46,800 +10,000 5,569,900 +41,800 +5,000 5,564,900 +36,800 ± 0 5,559,900 +31,800 -5,000 5,554,900 +26,800 -10,000 5,549,900 +21,800 -15,000 5,544,900 +16,800 -20,000 5,539,900 +11,800 -25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	9時20分の	日銀当座	前日比
$\begin{array}{c} +40,000 & 5,599,900 & +71,800 \\ +35,000 & 5,594,900 & +66,800 \\ +30,000 & 5,589,900 & +61,800 \\ +25,000 & 5,584,900 & +56,800 \\ +20,000 & 5,579,900 & +51,800 \\ +15,000 & 5,574,900 & +46,800 \\ +10,000 & 5,569,900 & +41,800 \\ +5,000 & 5,564,900 & +36,800 \\ \pm & 0 & 5,559,900 & +31,800 \\ -5,000 & 5,554,900 & +26,800 \\ -10,000 & 5,549,900 & +21,800 \\ -15,000 & 5,544,900 & +16,800 \\ -20,000 & 5,539,900 & +11,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -30,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -35,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -40,000 & 5,519,900 & -8,200 \end{array}$	オペ	預金残高	増減
+35,000 5,594,900 +66,800 +30,000 5,589,900 +61,800 +25,000 5,584,900 +56,800 +20,000 5,579,900 +51,800 +15,000 5,574,900 +46,800 +10,000 5,569,900 +41,800 +5,000 5,564,900 +36,800 ± 0 5,559,900 +31,800 -5,000 5,554,900 +26,800 -10,000 5,549,900 +21,800 -15,000 5,544,900 +16,800 -20,000 5,539,900 +11,800 -25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	+45,000	5,604,900	+76,800
$\begin{array}{c} +30,000 & 5,589,900 & +61,800 \\ +25,000 & 5,584,900 & +56,800 \\ +20,000 & 5,579,900 & +51,800 \\ +15,000 & 5,574,900 & +46,800 \\ +10,000 & 5,569,900 & +41,800 \\ +5,000 & 5,564,900 & +36,800 \\ \pm & 0 & 5,559,900 & +31,800 \\ -5,000 & 5,554,900 & +26,800 \\ -10,000 & 5,549,900 & +21,800 \\ -15,000 & 5,544,900 & +16,800 \\ -25,000 & 5,539,900 & +11,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -30,000 & 5,524,900 & +6,800 \\ -30,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -40,000 & 5,519,900 & -8,200 \\ \end{array}$	+40,000	5,599,900	+71,800
$\begin{array}{c} +25,000 & 5,584,900 & +56,800 \\ +20,000 & 5,579,900 & +51,800 \\ +15,000 & 5,574,900 & +46,800 \\ +10,000 & 5,569,900 & +41,800 \\ +5,000 & 5,564,900 & +36,800 \\ \pm & 0 & 5,559,900 & +31,800 \\ -5,000 & 5,554,900 & +26,800 \\ -10,000 & 5,549,900 & +21,800 \\ -15,000 & 5,549,900 & +16,800 \\ -20,000 & 5,534,900 & +16,800 \\ -20,000 & 5,534,900 & +11,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -30,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -40,000 & 5,519,900 & -8,200 \\ \end{array}$	+35,000	5,594,900	+66,800
$\begin{array}{c} +20,000 & 5,579,900 \\ +15,000 & 5,574,900 & +46,800 \\ +10,000 & 5,569,900 & +41,800 \\ +5,000 & 5,564,900 & +36,800 \\ \pm & 0 & 5,559,900 & +31,800 \\ -5,000 & 5,554,900 & +26,800 \\ -10,000 & 5,549,900 & +21,800 \\ -15,000 & 5,544,900 & +16,800 \\ -20,000 & 5,534,900 & +16,800 \\ -20,000 & 5,534,900 & +11,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -30,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -35,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -40,000 & 5,519,900 & -8,200 \\ \end{array}$	+30,000	5,589,900	+61,800
$\begin{array}{c} +15,000 & 5,574,900 & +46,800 \\ +10,000 & 5,569,900 & +41,800 \\ +5,000 & 5,564,900 & +36,800 \\ \pm & 0 & 5,559,900 & +31,800 \\ -5,000 & 5,554,900 & +26,800 \\ -10,000 & 5,549,900 & +21,800 \\ -15,000 & 5,544,900 & +16,800 \\ -20,000 & 5,539,900 & +11,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -30,000 & 5,524,900 & +6,800 \\ -35,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -40,000 & 5,519,900 & -8,200 \\ \end{array}$	+25,000	5,584,900	+56,800
$\begin{array}{c} +10,000 & 5,569,900 & +41,800 \\ +5,000 & 5,564,900 & +36,800 \\ \hline \pm & 0 & 5,559,900 & +31,800 \\ -5,000 & 5,554,900 & +26,800 \\ -10,000 & 5,549,900 & +21,800 \\ -15,000 & 5,544,900 & +16,800 \\ -20,000 & 5,539,900 & +11,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -25,000 & 5,534,900 & +6,800 \\ -30,000 & 5,529,900 & +1,800 \\ -35,000 & 5,524,900 & -3,200 \\ -40,000 & 5,519,900 & -8,200 \\ \hline \end{array}$	+20,000	5,579,900	+51,800
$\begin{array}{c ccccccccccccccccccccccccccccccccccc$	+15,000	5,574,900	+46,800
$\begin{array}{c ccccccccccccccccccccccccccccccccccc$	+10,000	5,569,900	+41,800
-5,000 5,554,900 +26,800 -10,000 5,549,900 +21,800 -15,000 5,544,900 +16,800 -20,000 5,539,900 +11,800 -25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	+5,000	5,564,900	+36,800
-10,000 5,549,900 +21,800 -15,000 5,544,900 +16,800 -20,000 5,539,900 +11,800 -25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	± 0	5,559,900	+31,800
-15,000 5,544,900 +16,800 -20,000 5,539,900 +11,800 -25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	-5,000	5,554,900	+26,800
-20,000 5,539,900 +11,800 -25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	-10,000	5,549,900	+21,800
-25,000 5,534,900 +6,800 -30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	-15,000	5,544,900	+16,800
-30,000 5,529,900 +1,800 -35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	-20,000	5,539,900	+11,800
-35,000 5,524,900 -3,200 -40,000 5,519,900 -8,200	-25,000	5,534,900	+6,800
-40,000 5,519,900 -8,200	-30,000	5,529,900	+1,800
	-35,000	5,524,900	-3,200
-45,000 5,514,900 -13,200	-40,000	5,519,900	-8,200
	-45,000	5,514,900	-13,200

<u> </u>	ロボノ ※スハースの関係上、	内谷で目略り	つ物ロかめりまり	。許禰は笄紅ロビマ	とこ参照ください。	
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 4/20	応札	0億 落札	0億	固定利回較差 +0.030%	
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 4/20	応札	0億 落札	0億	固定利回較差 +0.186%	
(10:40) 米ドル資金供給	23/ 4/21-23/ 4/28	応札	Omil 落札	Omil	貸付 5.080%	
(11:50) 国債補完供給	23/ 4/19-23/ 4/20	応札	94億 落札	94億 全取	-1.100% 平均 -1.510%	
(11:50) 国債補完供給	23/ 4/19-23/ 4/20	応札 2	29,512億 落札:	29,512億 全取	-0.350% 平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 4/19-23/ 4/20	応札	20億 落札	20億 全取	-0.350% 平均 -0.350%	
			•		•	·

<4月19日 各オペ残器	あと内訳> (カッコ内は	先日付スタート・#印はエン	ドが13時同時処理)	
			して行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給
102,116	45,122	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.	4/17(1-3Y) 4,257.	52,200	722,786	5/14~ 5/12 300.
1/6~1/6 20,014.	4/17(3-5Y) 5,006.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.	6/11~ 5/12 596.
1/10~ 1/10 20,011.	4/17(5-10Y) 6,760.	6/5~6/5 5.	9/17~ 9/15 13,014.	8/20~ 8/18 0.
1/13~ 1/14 20,008.	4/17(25Y-) 1,006.	9/3~9/1 1,940.	12/16~12/15 20,601.	11/19~11/17 0.
1/16~ 1/16 20,009.	4/17(変国) 300.	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.		5/17~ 5/17 0.
4/19~ 5/10 10,895.		3/ 4~ 3/ 4 2,178.	※直近約1年分の期落ち分を記載	8/19~ 8/19 381.
		6/3~6/3 1,950.	米ドル資金供給オペ	
		9/ 2~ 9/ 2 1,804.	1百万ドル	2/17~ 2/17 346.
			4/13~ 4/20 0.	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	4/14~ 4/21 0.	
		成長基盤強化支援米ドル特則	4/17~ 4/24 0.	
		17,709百万ドル	4/18~ 4/25 1.	
		6/ 3~ 6/ 2 5,848.	4/19~ 4/26 0.	
		9/ 2~ 9/ 5 6,101.	(4/20~4/27 0.)	
		12/ 2~12/ 4 3,607.	(4/21~4/28 0.)	
国債補完供給		3/ 3~ 3/ 4 2,153.		
29,626				
4/19~ 4/20 20.		国債買現先オペ		
4/19~ 4/20 94.		0		
4/19~ 4/20 29,512.			新型コロナ企業金融支援	
			59,810	
			1/27~ 4/27 2,514.	
国債売現先(米ドルオペ用担保)			2/28~ 5/26 5,355.	
2		国債売現先オペ	3/31~ 6/30 51,941.	
4/17~ 4/26 2.	※直近約1週間の実施分を記載	0		
	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			気候変動対応支援資金供給
3,000				44,214
4/6 1,000.				7/21~ 7/21 15,953.
4/12 1,000.		CP買入額(月初来)		1/30~ 1/30 28,261.
4/19 1,000.		3,995		
		4/13 3,995.	<4月19日 日銀信用	
				CP等買入(推定) 23,300
				社債等買入(推定) 79,600
ETF買入額			被災地金融機関支援 1,716	
356,220			気候変動対応支援 44,214	
約定 23/ 3/14 701.]	社債買入額(月初来)	成長基盤支援 47,971	
ETF買入額(企業支援)]	0	貸出増加支援 650,943	
14,628]	(4/21 1,000.)		国債売現先 0
約定 21/ 3/31 12.]		供給オペ合計 906,770	
J-REIT買入額]		7 H (1 H /C /	国売現(米ドル担保) 2
6,823]		供給額合計 906,770	
約定 22/ 6/14 12.	※直近約1週間の実施分を記載		差し引き	877,142
※ 武 巨 甘 般 没 🗸	レナゼ次へ供外へをするは	登付口 ぶ 文押口が同じも	旦合まとめて圭二」ていまっ	_

※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19日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	3±3HV3 77	الشدران	メルロレー・バーチル	4.01	/				
	NCD/CP現先	CI	プライマリ	TE	3アウトライト		<4月18日の:	1-ル市場残高(単位:億円)
S/N	0.000	1M	+0.001000	3M	買気配 -0.130			残高	増減
1W	売気配 -0.020	2M		6M	買気配 -0.100	Г	市場合計	205,300	+649
2W	売気配 -0.020	3M		1Y	買気配 -0.030		有担保	24,839	-2,517
1M	売気配 -0.020						無担保	180.461	+3.166

~4月19日	<4月19日のコール巾場レート迷報と東京レホ・レート(早世:%)>									
		無担保	コール			有担保コール				ポレート
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均值	前日比
翌日物	-0.045	0.001	-0.010	-0.001					-0.100	-0.001
トムネ									-0.111	-0.001
スポネ										
1週間物			-0.008	+0.010					-0.125	+0.001
2週間物			-0.019	-0.012					-0.140	+0.002
3週間物			-0.005	+0.007					-0.148	+0.003
1ヶ月物									-0.153	+0.001
3ヶ月物									-0.165	+0.001
6ヶ月物									-0.131	± 0
1年物									-0.099	± 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