

東京短資デイリーレポート

2023/4/19

<4月18日のマナタリーベース>

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	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比	+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		
銀行券要因		-500
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	
国債補充供給	+37,300	-29,400
金融調節合計		+11,200
当座預金増減-②		+3,400

<4月19日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,528,100
準備預金残高	4,817,700
積み終了先	4,809,100
超過準備	4,807,900
非準備先残高	710,400

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,846,600
今積み期間所要準備額(平均)	128,200
残り要積立額(積数)	36,700
残り要積立額(平均)	1,400
準備進捗率(%)	99.0
日数進捗率(%)	13.3
進捗率乖離幅	+85.7

<4月20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		-1,300
財政等要因		+3,900
資金過不足		+2,600
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	
国債補充供給	+29,400	
金融調節合計		+29,200
当座預金増減		+31,800

<4月20日のオペ予想>

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% での合いが中心か。

<4月20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	5,604,900	+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
+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	5,514,900	-13,200

<4月19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/ 4/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.030%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 4/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.186%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 4/21-23/ 4/28	応札	0m1	落札	0m1	貸付	5.080%
(11:50) 国債補充供給	23/ 4/19-23/ 4/20	応札	94億	落札	94億	全取	-1.100% 平均 -1.510%
(11:50) 国債補充供給	23/ 4/19-23/ 4/20	応札	29,512億	落札	29,512億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給	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	
102,116	45,122	成長基盤強化支援資金供給	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(夙国) 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.		8/19~ 8/19 381.
		6/ 3~ 6/ 3 1,950.		11/18~11/18 93.
		9/ 2~ 9/ 2 1,804.		2/17~ 2/17 346.
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			1百万ドル	
			4/13~ 4/20 0.	
			4/14~ 4/21 0.	
			4/17~ 4/24 0.	
			4/18~ 4/25 1.	
			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.)
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
			国債買入先オペ	
			0	
			国債売入先オペ	
			0	
			新型コロナ企業金融支援	
			59,810	
			1/27~ 4/27 2,514.	
			2/28~ 5/26 5,355.	
			3/31~ 6/30 51,941.	
			気候変動対応支援資金供給	
			44,214	
			7/21~ 7/21 15,953.	
			1/30~ 1/30 28,261.	
			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	
			CP買入額(月初来)	
			3,995	
			4/13 3,995.	
			社債買入額(月初来)	
			0	
			(4/21 1,000.)	
			貸出増加支援	
			650,943	手形売出 0
			59,810	国債売現先 0
			906,770	国債補充供給 29,626
			0	国債売現先(米ドル担保) 2
			906,770	吸収額合計 29,628
			差引き	877,142

※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:%)>

	NCD/CP現先	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N	0.000	1M +0.001000	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18日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	205,300	+649
有担保	24,839	-2,517
無担保	180,461	+3,166

<4月19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	-0.045	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