東京短資デイリーレポート

2024/7/3

| 差し引き | 1,043,079|

増減 +35 +175 -140

<7月2日のマネタリーベース>

6,744,500

<7月3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 5,468,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,510,000
日銀当座預金残高増減前日上	七 -41,900

<7月3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			-15,400
財政等要因			-59,900
資金過不足			-75,300
金融調節			_
	#0	24-	☆ビ+ロ

I		期	落	新規
	国債補完供給	+31	,000	-25,800
	金融調節合計			+5,200
_	当座預金増減-②			-70,100

<7月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,439,900
準備預金残高	4,837,900
積み終了先	4,837,800
超過準備	4,837,800
非準預先残高	602,000

<参考>

3,942,000
131,400
500
0
99.9
60.0
+39.9

<7月4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			-3,600
ш	財政等要因			+1,000
ш	資金過不足			-2,600
	金融調節確定分			
		期	落	新規
ш	国債買入			+10,800
ш	国債補完供給	+25	,800	
ш	金融調節合計			+36,600
	当座預金増減			+34,000

<7月4日のオペ予想> 朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆3,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%∼+0.080% 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 5,518,900 +79,000 +40,000 5,513,900 +74,000 +35,000 5,508,900 +69,000 +30,000 5,503,900 +64,000 +25,000 5,498,900 +59,000 +20,000 5,498,900 +59,000 +15,000 5,488,900 +49,000 +10,000 5,488,900 +49,000 +10,000 5,478,900 +39,000 ± 0 5,473,900 +34,000 -5,000 5,468,900 +29,000 -10,000 5,468,900 +24,000 -15,000 5,458,900 +19,000 -20,000 5,453,900 +14,000 -25,000 5,448,900 +9,000 -30,000 5,438,900 -1,000 -35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	7月4日9時20分(カオペによる日	眼当座預金状況
$\begin{array}{c} +45,000 \\ +40,000 \\ 5,518,900 \\ +79,000 \\ +35,000 \\ 5,508,900 \\ +69,000 \\ +30,000 \\ 5,503,900 \\ +64,000 \\ +25,000 \\ 5,498,900 \\ +59,000 \\ +20,000 \\ 5,498,900 \\ +54,000 \\ +15,000 \\ 5,488,900 \\ +49,000 \\ +115,000 \\ 5,488,900 \\ +49,000 \\ +10,000 \\ 5,488,900 \\ +49,000 \\ +10,000 \\ 5,483,900 \\ +39,000 \\ +5,000 \\ 5,473,900 \\ +34,000 \\ -5,000 \\ 5,468,900 \\ +29,000 \\ -10,000 \\ 5,468,900 \\ +29,000 \\ -15,000 \\ 5,458,900 \\ +19,000 \\ -20,000 \\ 5,448,900 \\ +9,000 \\ -25,000 \\ 5,448,900 \\ +9,000 \\ -30,000 \\ 5,443,900 \\ +4,000 \\ -35,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -35,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -35,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -35,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -35,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -35,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -35,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -30,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -30,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -30,000 \\ -30,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -30,000 \\ -30,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -30,000 \\ -30,000 \\ -30,000 \\ -30,000 \\ 5,438,900 \\ -1,000 \\ -30,000 \\$	9時20分の	日銀当座	前日比
$\begin{array}{c} +40,000 & 5,513,900 & +74,000 \\ +35,000 & 5,508,900 & +69,000 \\ +30,000 & 5,503,900 & +64,000 \\ +25,000 & 5,498,900 & +59,000 \\ +20,000 & 5,493,900 & +59,000 \\ +15,000 & 5,488,900 & +49,000 \\ +10,000 & 5,483,900 & +44,000 \\ +10,000 & 5,483,900 & +39,000 \\ \pm & 0 & 5,478,900 & +39,000 \\ \pm & 0 & 5,473,900 & +34,000 \\ -5,000 & 5,468,900 & +29,000 \\ -10,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -15,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -20,000 & 5,453,900 & +14,000 \\ -25,000 & 5,443,900 & +9,000 \\ -30,000 & 5,443,900 & +4,000 \\ -35,000 & 5,433,900 & -1,000 \\ -40,000 & 5,433,900 & -6,000 \\ \end{array}$	オペ	預金残高	増減
$\begin{array}{c} +35,000 & 5,508,900 & +69,000 \\ +30,000 & 5,503,900 & +64,000 \\ +25,000 & 5,498,900 & +59,000 \\ +20,000 & 5,493,900 & +54,000 \\ +15,000 & 5,488,900 & +49,000 \\ +10,000 & 5,488,900 & +44,000 \\ +5,000 & 5,478,900 & +39,000 \\ \pm & 0 & 5,473,900 & +34,000 \\ -5,000 & 5,468,900 & +29,000 \\ -10,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -15,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -25,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -25,000 & 5,448,900 & +9,000 \\ -25,000 & 5,448,900 & +9,000 \\ -30,000 & 5,443,900 & +4,000 \\ -35,000 & 5,433,900 & -1,000 \\ -40,000 & 5,433,900 & -6,000 \end{array}$	+45,000	5,518,900	+79,000
$\begin{array}{c} +30,000 & 5,503,900 & +64,000 \\ +25,000 & 5,498,900 & +59,000 \\ +20,000 & 5,493,900 & +54,000 \\ +15,000 & 5,488,900 & +49,000 \\ +10,000 & 5,488,900 & +49,000 \\ +5,000 & 5,478,900 & +39,000 \\ \pm & 0 & 5,478,900 & +34,000 \\ -5,000 & 5,468,900 & +29,000 \\ -10,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -15,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -25,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -25,000 & 5,448,900 & +9,000 \\ -25,000 & 5,448,900 & +4,000 \\ -30,000 & 5,443,900 & +4,000 \\ -35,000 & 5,438,900 & -1,000 \\ -40,000 & 5,433,900 & -6,000 \\ \end{array}$	+40,000	5,513,900	+74,000
$\begin{array}{c} +25,000 & 5,498,900 & +59,000 \\ +20,000 & 5,493,900 & +54,000 \\ +15,000 & 5,488,900 & +49,000 \\ +10,000 & 5,483,900 & +44,000 \\ +5,000 & 5,478,900 & +39,000 \\ \hline \pm & 0 & 5,473,900 & +34,000 \\ -5,000 & 5,468,900 & +29,000 \\ -10,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -15,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -20,000 & 5,453,900 & +14,000 \\ -25,000 & 5,453,900 & +14,000 \\ -30,000 & 5,443,900 & +4,000 \\ -35,000 & 5,438,900 & -1,000 \\ -40,000 & 5,433,900 & -6,000 \\ \end{array}$	+35,000	5,508,900	+69,000
$\begin{array}{c} +20,000 & 5,493,900 & +54,000 \\ +15,000 & 5,488,900 & +49,000 \\ +10,000 & 5,488,900 & +44,000 \\ +5,000 & 5,478,900 & +39,000 \\ & \pm & 0 & 5,473,900 & +34,000 \\ -5,000 & 5,468,900 & +29,000 \\ -10,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -15,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -20,000 & 5,453,900 & +14,000 \\ -25,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -25,000 & 5,448,900 & +9,000 \\ -30,000 & 5,443,900 & +4,000 \\ -35,000 & 5,438,900 & -1,000 \\ -40,000 & 5,433,900 & -6,000 \\ \end{array}$	+30,000	5,503,900	+64,000
$\begin{array}{c} +15,000 & 5,488,900 & +49,000 \\ +10,000 & 5,483,900 & +44,000 \\ +5,000 & 5,478,900 & +39,000 \\ \hline \pm & 0 & 5,473,900 & +34,000 \\ -5,000 & 5,468,900 & +29,000 \\ -10,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -15,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -20,000 & 5,453,900 & +19,000 \\ -20,000 & 5,453,900 & +14,000 \\ -25,000 & 5,448,900 & +9,000 \\ -30,000 & 5,443,900 & +4,000 \\ -35,000 & 5,438,900 & -1,000 \\ -40,000 & 5,433,900 & -6,000 \end{array}$	+25,000	5,498,900	+59,000
$\begin{array}{c} +10,000 & 5,483,900 & +44,000 \\ +5,000 & 5,478,900 & +39,000 \\ \hline \pm & 0 & 5,473,900 & +34,000 \\ -5,000 & 5,468,900 & +29,000 \\ -10,000 & 5,463,900 & +24,000 \\ -15,000 & 5,458,900 & +19,000 \\ -20,000 & 5,458,900 & +14,000 \\ -25,000 & 5,453,900 & +14,000 \\ -25,000 & 5,448,900 & +9,000 \\ -30,000 & 5,443,900 & +4,000 \\ -35,000 & 5,438,900 & -1,000 \\ -40,000 & 5,433,900 & -6,000 \\ \hline \end{array}$	+20,000	5,493,900	+54,000
$\begin{array}{c ccccccccccccccccccccccccccccccccccc$	+15,000	5,488,900	+49,000
$\begin{array}{c ccccccccccccccccccccccccccccccccccc$	+10,000	5,483,900	+44,000
-5,000 5,468,900 +29,000 -10,000 5,463,900 +24,000 -15,000 5,458,900 +19,000 -20,000 5,453,900 +14,000 -25,000 5,448,900 +9,000 -30,000 5,443,900 +4,000 -35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	+5,000	5,478,900	+39,000
-10,000 5,463,900 +24,000 -15,000 5,458,900 +19,000 -20,000 5,453,900 +14,000 -25,000 5,448,900 +9,000 -30,000 5,443,900 +4,000 -35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	± 0	5,473,900	+34,000
-15,000 5,458,900 +19,000 -20,000 5,453,900 +14,000 -25,000 5,448,900 +9,000 -30,000 5,443,900 +4,000 -35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	-5,000	5,468,900	+29,000
-20,000 5,453,900 +14,000 -25,000 5,448,900 +9,000 -30,000 5,443,900 +4,000 -35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	-10,000	5,463,900	+24,000
-25,000 5,448,900 +9,000 -30,000 5,443,900 +4,000 -35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	-15,000	5,458,900	+19,000
-30,000 5,443,900 +4,000 -35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	-20,000	5,453,900	+14,000
-35,000 5,438,900 -1,000 -40,000 5,433,900 -6,000	-25,000	5,448,900	+9,000
-40,000 5,433,900 -6,000	-30,000	5,443,900	+4,000
	-35,000	5,438,900	-1,000
45 000 5 429 000 11 000	-40,000	5,433,900	-6,000
<u> </u>	-45,000	5,428,900	-11,000

※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(-1Y)	24/ 7/ 4	1,500億	応札	4,262億	落札	1,500億	最低	-0.010%	平均	+0.005%	按分	0.1
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	24/ 7/ 4	3,750億	応札	11,320億	落札	3,754億	最低	-0.014%	平均	-0.010%	按分	19.2
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 7/ 4	4,250億	応札	8,045億	落札	4,255億	最低	-0.019%	平均	-0.015%	按分	84.0
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 7/ 4	1,500億	応札	3,908億	落札	1,504億	最低	+0.007%	平均	+0.010%	按分	67.6
(11:50) 国債補完供給	24/ 7/ 3-24/ 7/ 4		応札	26,568億	落札	26,568億	全取	-0.150%	平均	-0.150%		
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/ 3-24/ 7/ 4		応札	0億	落札	0億						

∠7 ₽2□ \$	7 ナ 心 味 古	レ曲部 へ / :		#D435	U CD (+ - >)	1 × 12 + 2 0 + 10 100	`		
<7月3日 名				先日付スタート・				14/// Id. A 51 18/00 4	100 No. 0 (11 60
		国債買入額()							
99,	226	7,1		成長基盤強化支持		貸出増加支援		1,0	01
6/26~ 7/10	8,005.	7/ 1(3-5Y)	4,252.	31,5	2 3	868,6	5 5 8	8/19~ 8/19	381.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	7/ 1(10-25Y)	1,506.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.	11/18~11/18	93.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/ 1(25Y-)	752.	12/ 2~12/ 2	1,712.	12/15~12/13	54,701.	2/17~ 2/17	346.
1/10~ 1/10	20,011.	7/1(物国)	600.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	3/17~ 3/17	64,498.	5/17~ 5/12	0.
1/13~ 1/14		(7/4(-1Y)		6/ 2~ 6/ 2	2,644.		26,498.	5/12~ 5/12	181.
1/16~ 1/16		(7/4(1-3Y)		9/ 1~ 9/ 1	5,024.	', ' ', '	,	8/18~ 8/18	0.
1/19~ 1/20		(7/4(3-5Y)		12/ 1~12/ 1		※直近約1年分の期	変ち分を記載		0.
1/13 1/20		(7/4(10-25Y)				米ドル資金			0.
		(1/ 4(10-231)	1,304.)					2/10 2/10	0.
				6/ 3~ 6/ 3	3,160.		<u>百万ドル</u>		
				w +>5664 = () = #0	++ () += == +=	6/27~ 7/ 5	0.		
				※直近約1年分の期		(1/ 5~ 1/11	0.)		
				成長基盤強化支援					
				16,122	<u>白万ドル</u>				
				9/ 5~ 9/ 5	5,382.			気候変動対応支払	
共通担保(全局	吉)金利入札			12/ 4~12/ 4	3,325.			81,6	66
70,	035			3/ 4~ 3/ 4	2,097.			7/21~ 7/19	34,398.
1/24~ 1/24	10,003.			6/ 3~ 6/ 3	5,318.			1/30~ 1/30	47,268.
2/ 1~ 2/ 1	10,004.								
2/15~ 2/15	10,004.			国債買現分	トオペ				
3/ 1~ 3/ 1					0	国債売現先(米ドル	オペ用担保)		
9/15~ 9/15						, , ,	0		
10/10~10/10									
10/25~10/25									
10/23 10/23	10,003.					国庫短期証券買入	頞(日初本)		
				国債売現分	F → ^∘	国库加利亚分支八	0		
		※直近約1週間の実施	₩./\+.= 1 #	国	0				
					U				
		国債買入額(固定利回							
同佳井	5 /LL 6/2		0						
国債補知									
	568								
7/ 3~ 7/ 4				CP買入額(<u>月初米)</u>				
7/ 3~ 7/ 4	0.				0				
						<u><7月3日 日</u>	銀信用機	既算(除く買切)>
						共通担保(全)固定	99,226	CP等買入(推定)	20,700
						共通担保(全)金み		社債等買入(推定)	58,200
ETF買	入額					国債買現先			
356,	9 2 1					被災地金融機関支援	1,001		
約定 23/10	/ 4 701.			社債買入額(月初来)	気候変動対応支援	₹ 81.663		
ETF買入額(:					0	成長基盤支援			0
	628						, , , , ,	国債売現先	0
約定 21/ 3								国債補完供給	26,568
J-REIT						貸出(推定)		国売現(米ドル担保)	20,300
	<u> </u>							吸収額合計	26,568
0,	0 2 3			İ		[六阳00日]	1,000,041	火火战员口引	∠0,508

※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。

<7月3日のオープン市場気配レート(単位:%)>

約定 22/ 6/14 12. ※直近約1週間の実施分を記載

	NCD/CP現先	C	アプライマリ	TE	3アウトライト	<7月2日のコ・	ル市場残高(単	単位:億円)
S/N	+0.070	1M	+0.170000	3M	買気配 +0.050		残高	増減
1W	売気配 +0.070	2M	+0.140000	6M	買気配 +0.150	市場合計	115,583	+35
2W	売気配 +0.070	3M		1Y	買気配 +0.150	有担保	38,235	+175
1 M						無扣俘	77 348	-140

<7月3日のコール市場レート迷報と果京レホ・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	平均值	前日比		
翌日物	0.050	0.078	0.077	± 0					0.047	-0.031		
トムネ									0.051	-0.028		
スポネ												
1週間物	0.240	0.250	0.248	+0.123					0.051	-0.003		
2週間物									0.051	± 0		
3週間物									0.051	± 0		
1ヶ月物									0.051	± 0		
3ヶ月物									0.084	± 0		
6ヶ月物									0.139	± 0		
1年物									0.200	± 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