

東京短資デイリーレポート

2024/7/5

<7月4日のマナリーベース>

6,704,200

<7月5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	5,468,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,450,600
日銀当座預金残高増減前日比	+17,500

<7月5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		-1,600
財政等要因		+5,100
資金過不足		+3,500
金融調節		
CP等買入	期落	新規
	-300	
国債補完供給	+24,000	-22,500
金融調節合計		+1,200
当座預金増減-②		+4,700

<7月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,455,300
準備預金残高	4,845,100
積み終了先	4,845,000
超過準備	4,845,000
非準備先残高	610,200

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,944,900
今積み期間所要準備額(平均)	131,500
残り要積立額(積数)	200
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	73.3
進捗率乖離幅	+26.6

<7月8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		+300
財政等要因		+5,600
資金過不足		+5,900
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
	-300	
社債等買入		-100
国債補完供給	+22,500	
金融調節合計		+22,100
当座預金増減		+28,000

<7月8日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆3,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月8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	5,528,300	+73,000
+40,000	5,523,300	+68,000
+35,000	5,518,300	+63,000
+30,000	5,513,300	+58,000
+25,000	5,508,300	+53,000
+20,000	5,503,300	+48,000
+15,000	5,498,300	+43,000
+10,000	5,493,300	+38,000
+5,000	5,488,300	+33,000
±0	5,483,300	+28,000
-5,000	5,478,300	+23,000
-10,000	5,473,300	+18,000
-15,000	5,468,300	+13,000
-20,000	5,463,300	+8,000
-25,000	5,458,300	+3,000
-30,000	5,453,300	-2,000
-35,000	5,448,300	-7,000
-40,000	5,443,300	-12,000
-45,000	5,438,300	-17,000

<7月5日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/7/5-24/7/8	応札 23,084億 落札 23,084億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/7/5-24/7/8	応札 0億 落札 0億

<7月5日 各オペ残高と内訳>

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				
99,226	6	18,123	3	1,523	868,658	1,001	381			
6/26~7/10	8,005	7/1(3-5Y)	4,252	9/2~9/2	1,804	9/16~9/13	132,310	11/18~11/18	93	
1/6~1/6	20,014	7/1(10-25Y)	1,506	12/2~12/2	1,712	12/15~12/13	54,701	2/17~2/17	346	
1/5~1/6	10,016	7/1(25Y-)	752	3/3~3/3	6,793	3/17~3/17	64,498	5/17~5/12	0	
1/10~1/10	20,011	7/1(物国)	600	6/2~6/2	2,644	6/18~6/18	26,498	5/12~5/12	181	
1/13~1/14	20,008	7/4(-1Y)	1,500	9/1~9/1	5,024			8/18~8/18	0	
1/16~1/16	20,009	7/4(1-3Y)	3,754	12/1~12/1	2,464			11/17~11/17	0	
1/19~1/20	1,163	7/4(3-5Y)	4,255	3/2~3/2	7,922			2/16~2/16	0	
		7/4(10-25Y)	1,504	6/3~6/3	3,160					
				※直近約1年分の期落ち分を記載		米ドル資金供給オペ				
				成長基盤強化支援米ドル特別		0百万ドル				
				16,122百万ドル		7/5~7/11		0		
				9/5~9/5		5,382		気候変動対応支援資金供給		
				12/4~12/4		3,325		81,666		
				3/4~3/4		2,097		7/21~7/19		34,398
				6/3~6/3		5,318		1/30~1/30		47,268
				国債買現先オペ		0				
				国債売現先(米ドルオペ用担保)		0				
				国債売現先オペ		0				
				国債買入額(固定利回)(月初来)		0				
				0						
				C/P買入額(月初来)		0				
				0						
				社債買入額(月初来)		0				
				0						
				ETF買入額		356,921				
				約定23/10/4		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				
				国債補完供給		23,084				
				7/5~7/8		0				
				ETF買入額		356,921				
				約定23/10/4		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				
				国債補完供給		23,084				
				7/5~7/8		0				
				ETF買入額		356,921				
				約定23/10/4		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				

※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5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	+0.070	1M	-----	3M	買気配 +0.030
1W	売気配 +0.070	2M	買気配 +0.23000	06M	買気配 +0.100
2W	売気配 +0.070	3M	-----	1Y	買気配 +0.200
1M	売気配 +0.070				

<7月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,508	+1,540
有担保	39,941	+827
無担保	80,567	+713

<7月5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	0.050	0.078	0.077	±0				-----	0.051	-0.003
トムネ				-----				-----	0.067	+0.023
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.052	+0.002
2週間物				-----				-----	0.051	+0.001
3週間物				-----				-----	0.052	+0.001
1ヶ月物	0.180	0.230	0.205	-----				-----	0.051	+0.001
3ヶ月物			0.220	-----				-----	0.086	+0.001
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