

東京短資デイリーレポート

2023/4/21

<4月20日のマネタリーベース>

6,795,200

<4月21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	5,552,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,529,600
日銀当座預金残高増減前日比	+22,400

<4月21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		-700
財政等要因		-8,100
資金過不足		-8,800
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入	-300	+1,000
国債補充供給	+30,200	-27,800
金融調節合計		+2,900
当座預金増減-②		-5,900

<4月21日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,523,700
準備預金残高	4,816,400
積み終了先	4,813,500
超過準備	4,812,600
非準備先残高	707,300

<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)	19,400
残り要積立額 (平均)	900
準備進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	26.7
進捗率乖離幅	+72.7

<4月24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		-900
財政等要因		+8,700
資金過不足		+7,800
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+18,500
CP等買入	-100	
国債補充供給	+27,800	
金融調節合計		+46,200
当座預金増減		+54,000

<4月24日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残557兆7,700億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<4月24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	5,622,700	+99,000
+40,000	5,617,700	+94,000
+35,000	5,612,700	+89,000
+30,000	5,607,700	+84,000
+25,000	5,602,700	+79,000
+20,000	5,597,700	+74,000
+15,000	5,592,700	+69,000
+10,000	5,587,700	+64,000
+5,000	5,582,700	+59,000
±0	5,577,700	+54,000
-5,000	5,572,700	+49,000
-10,000	5,567,700	+44,000
-15,000	5,562,700	+39,000
-20,000	5,557,700	+34,000
-25,000	5,552,700	+29,000
-30,000	5,547,700	+24,000
-35,000	5,542,700	+19,000
-40,000	5,537,700	+14,000
-45,000	5,532,700	+9,000

<4月21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(1Y-3Y)	23/ 4/24	4,250億 応札 11,864億 落札 4,255億 最低 +0.004% 平均 +0.005% 按分 69.3%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 4/24	5,000億 応札 8,552億 落札 5,005億 最低 -0.009% 平均 -0.007% 按分 48.2%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 4/24	6,750億 応札 13,447億 落札 6,755億 最低 -0.010% 平均 -0.007% 按分 12.9%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 4/24	2,500億 応札 5,246億 落札 2,502億 最低 -0.007% 平均 -0.003% 按分 96.9%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 4/24	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.030%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 4/24	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.190%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 4/25-23/ 5/11	応札 0mll 落札 0mll 貸付 5.140%
(11:50) 国債補充供給	23/ 4/21-23/ 4/24	応札 28,032億 落札 28,032億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補充供給	23/ 4/21-23/ 4/24	応札 0億 落札 0億

<4月21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	102,116	国債買入額(月初来)	45,122	成長基盤強化支援資金供給	52,200	貸出増加支援資金供給	722,786	被災地金融機関支援資金供給	1,716
1/ 5~ 1/ 6	10,016	4/17(1-3Y)	4,257	6/ 4~ 6/ 2	4,312	6/19~ 6/19	28,033	5/14~ 5/12	300
1/ 6~ 1/ 6	20,014	4/17(3-5Y)	5,006	6/ 5~ 6/ 5	5	9/17~ 9/15	13,014	6/11~ 5/12	596
1/10~ 1/10	20,011	4/17(5-10Y)	6,760	9/ 3~ 9/ 1	1,940	12/16~ 12/15	20,601	8/20~ 8/18	0
1/13~ 1/14	20,008	4/17(25Y-)	1,006	9/ 4~ 9/ 4	34	3/18~ 3/18	41,458	11/19~ 11/17	0
1/16~ 1/16	20,009	4/17(夙国)	300	12/ 4~ 12/ 4	10,258	8/19~ 8/19	381	2/18~ 2/16	0
1/19~ 1/20	1,163	(4/24(1-3Y)	4,255	3/ 4~ 3/ 4	2,178	2/17~ 2/17	346	5/17~ 5/17	0
4/19~ 5/10	10,895	(4/24(3-5Y)	5,005	6/ 3~ 6/ 3	1,950	※直近約1年分の期落ち分を記載		8/19~ 8/19	381
		(4/24(5-10Y)	6,755	9/ 2~ 9/ 2	1,804	米ドル資金供給オペ		11/18~ 11/18	93
		(4/24(10-25Y)	2,502			1百万ドル		2/17~ 2/17	346
						4/17~ 4/24	0		
						4/18~ 4/25	1		
						4/19~ 4/26	0		
						4/20~ 4/27	0		
						4/21~ 4/28	0		
						4/24~ 5/ 1	0		
						4/25~ 5/11	0		
						※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			
						17,709百万ドル			
						6/ 3~ 6/ 2	5,848		
						9/ 2~ 9/ 5	6,101		
						12/ 2~ 12/ 4	3,607		
						3/ 3~ 3/ 4	2,153		
						国債買入先オペ			
						0			
						国債売先オペ			
						0			
						※直近約1週間の実施分を記載			
						国債買入額(固定利回)(月初来)			
						0			
						国庫短期証券買入額(月初来)			
						3,000			
						4/ 6	1,000		
						4/12	1,000		
						4/19	1,000		
						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)			
						1,000			
						4/21	1,000		
						貸出増加支援	650,943	手形売出	0
						新型コロナウイルス企業金融支援	59,810	国債売先オペ	0
						供給オペ合計	906,770	国債補充供給	28,032
						貸出(推定)	0	国債売先オペ	2
						供給額合計	906,770	吸収額合計	28,034
						差し引き	878,736		

※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21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	+0.005000	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	+0.007000	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

<4月20日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	205,035	-3,556
有担保	26,706	+43
無担保	178,329	-3,599

<4月21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	-0.047	0.001	-0.010	-0.001					-0.098	+0.001
トムネ				-----					-0.110	±0
スポネ				-----						
1週間物			-0.023	-0.005					-0.127	-0.003
2週間物	-0.018	0.031	-0.009	+0.024					-0.141	+0.001
3週間物				-----					-0.148	+0.001
1ヶ月物				-----					-0.153	+0.001
3ヶ月物	0.004	0.480	0.019	-----					-0.163	+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