

# 東京短資デイリーレポート

2023/7/31

## <7月28日のマネタリーベース>

6,666,700
-----------

## <7月31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	5,474,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,405,700
日銀当座預金残高増減前日比	+69,200

## <7月31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	+600
財政等要因	+15,500
資金過不足	+16,100
金融調節	
国債買入	+8,400
CP等買入	-1,800
国債補完供給	+46,600
金融調節合計	+6,300
当座預金増減-②	+22,400

## <7月31日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,428,100
準備預金残高	4,728,800
積み終了先	4,727,400
超過準備	4,727,400
非準備先残高	699,300

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,015,900
今積み期間所要準備額 (平均)	129,500
残り要積立額 (積数)	11,900
残り要積立額 (平均)	800
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	51.6
進捗率乖離幅	+48.1

## <8月1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	+100
財政等要因	-26,300
資金過不足	-26,200
金融調節確定分	
国債買入	+3,200
国庫短期証券買入	+1,000
国債補完供給	+50,900
金融調節合計	+55,100
当座預金増減	+28,900

## <8月1日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残545兆7,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.080%~-0.060% での出合いが中心か。
--

## <8月1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	5,502,000	+73,900
+40,000	5,497,000	+68,900
+35,000	5,492,000	+63,900
+30,000	5,487,000	+58,900
+25,000	5,482,000	+53,900
+20,000	5,477,000	+48,900
+15,000	5,472,000	+43,900
+10,000	5,467,000	+38,900
+5,000	5,462,000	+33,900
±0	5,457,000	+28,900
-5,000	5,452,000	+23,900
-10,000	5,447,000	+18,900
-15,000	5,442,000	+13,900
-20,000	5,437,000	+8,900
-25,000	5,432,000	+3,900
-30,000	5,427,000	-1,100
-35,000	5,422,000	-6,100
-40,000	5,417,000	-11,100
-45,000	5,412,000	-16,100

## <7月31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(5Y-10Y)	23/ 8/ 1	3,000億	応札 8,724億 落札 3,002億	最低 +0.039% 平均 +0.043% 按分 50.2%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 8/ 1		応札 0億 落札 0億	固定利回差差 +0.455%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 8/ 1		応札 0億 落札 0億	固定利回差差 +0.670%
(10:10) 国庫短期証券買入	23/ 8/ 1	1,000億	応札 9,743億 落札 1,002億	最低 +0.009% 平均 +0.010% 按分 85.6%
(11:50) 国債補完供給	23/ 7/31-23/ 8/ 1		応札 51,301億 落札 51,301億	全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/ 7/31-23/ 8/ 1		応札 0億 落札 0億	

## <7月31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				
100,191	89,034	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給				
7/19~ 8/ 2	8,970.	47,883	754,212	8/20~ 8/18	0.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	9/17~ 9/15	13,014.	11/19~11/17	0.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.	2/18~ 2/16	0.
1/10~ 1/10	20,011.	12/ 4~12/ 4	10,258.	3/18~ 3/18	41,458.	5/17~ 5/17	0.
1/13~ 1/14	20,008.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.	8/19~ 8/19	381.
1/16~ 1/16	20,009.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	※直近約1年分の期落ち分を記載		11/18~11/18	93.
1/19~ 1/20	1,163.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	米ドル資金供給オペ		2/17~ 2/17	346.
		12/ 2~12/ 2	1,712.	1百万ドル		5/12~ 5/12	181.
		3/ 3~ 3/ 3	6,793.	7/27~ 8/ 3	1.		
		※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					
		17,427百万ドル					
		9/ 2~ 9/ 5	6,101.				
		12/ 2~12/ 4	3,607.				
		3/ 3~ 3/ 4	2,153.				
		6/ 2~ 6/ 3	5,566.				
		国債買入先オペ					
		0					
		国債売入先(米ドルオペ用担保)					
		0					
		国庫短期証券買入額(月初来)					
		国債売入先オペ					
		0					
		7/ 5	1,001.				
		7/12	1,001.				
		7/26	1,000.				
		(8/ 1	1,002.)				
		CP買入額(月初来)					
		7,982					
		7/14	3,996.				
		7/31	3,986.				
		社債買入額(月初来)					
		1,002					
		7/24	1,002.				
		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					
		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.				
		国債補完供給					
		7/31~ 8/ 1	51,301.				
		7/31~ 8/ 1	0.				
		共通担保(全店)金利入札					
		40,021					
		1/24~ 1/24	10,003.				
		2/ 1~ 2/ 1	10,004.				
		2/15~ 2/15	10,004.				
		3/ 1~ 3/ 1	10,010.				
		国債買入先オペ					
		0					
		国債売入先(米ドルオペ用担保)					
		0					
		国庫短期証券買入額(月初来)					
		国債売入先オペ					
		0					
		7/ 5	1,001.				
		7/12	1,001.				
		7/26	1,000.				
		(8/ 1	1,002.)				
		CP買入額(月初来)					
		7,982					
		7/14	3,996.				
		7/31	3,986.				
		社債買入額(月初来)					
		1,002					
		7/24	1,002.				
		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					
		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.				
		国債補完供給					
		7/31~ 8/ 1	51,301.				
		7/31~ 8/ 1	0.				
		共通担保(全店)金利入札					
		40,021					
		1/24~ 1/24	10,003.				
		2/ 1~ 2/ 1	10,004.				
		2/15~ 2/15	10,004.				
		3/ 1~ 3/ 1	10,010.				
		国債買入先オペ					
		0					
		国債売入先(米ドルオペ用担保)					
		0					
		国庫短期証券買入額(月初来)					
		国債売入先オペ					
		0					
		7/ 5	1,001.				
		7/12	1,001.				
		7/26	1,000.				
		(8/ 1	1,002.)				
		CP買入額(月初来)					
		7,982					
		7/14	3,996.				
		7/31	3,986.				
		社債買入額(月初来)					
		1,002					
		7/24	1,002.				
		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					
		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.				
		国債補完供給					
		7/31~ 8/ 1	51,301.				
		7/31~ 8/ 1	0.				
		共通担保(全店)金利入札					
		40,021					
		1/24~ 1/24	10,003.				
		2/ 1~ 2/ 1	10,004.				
		2/15~ 2/15	10,004.				
		3/ 1~ 3/ 1	10,010.				
		国債買入先オペ					
		0					
		国債売入先(米ドルオペ用担保)					
		0					
		国庫短期証券買入額(月初来)					
		国債売入先オペ					
		0					
		7/ 5	1,001.				
		7/12	1,001.				
		7/26	1,000.				
		(8/ 1	1,002.)				
		CP買入額(月初来)					
		7,982					
		7/14	3,996.				
		7/31	3,986.				
		社債買入額(月初来)					
		1,002					
		7/24	1,002.				
		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					
		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.				
		国債補完供給					
		7/31~ 8/ 1	51,301.				
		7/31~ 8/ 1	0.				
		共通担保(全店)金利入札					
		40,021					
		1/24~ 1/24	10,003.				
		2/ 1~ 2/ 1	10,004.				
		2/15~ 2/15	10,004.				
		3/ 1~ 3/ 1	10,010.				
		国債買入先オペ					
		0					
		国債売入先(米ドルオペ用担保)					
		0					
		国庫短期証券買入額(月初来)					
		国債売入先オペ					
		0					
		7/ 5	1,001.				
		7/12	1,001.				
		7/26	1,000.				
		(8/ 1	1,002.)				
		CP買入額(月初来)					
		7,982					
		7/14	3,996.				
		7/31	3,986.				
		社債買入額(月初来)					
		1,002					
		7/24	1,002.				
		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					