

東京短資デイリーレポート

2024/4/5

<4月4日のマナリーベース>

6,824,600

<4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	5,609,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,570,000
日銀当座預金残高増減前日比	+39,500

<4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		+800
財政等要因		+5,400
資金過不足		+6,200
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補完供給	+38,300	-36,400
金融調節合計		+1,800
当座預金増減-②		+8,000

<4月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,578,000
準備預金残高	4,917,800
積み終了先	4,917,700
超過準備	4,917,700
非準備先残高	660,200

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,056,600
今積み期間所要準備額(平均)	130,900
残り要積立額(積数)	100
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	74.2
進捗率乖離幅	+25.7

<4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		+900
財政等要因		-5,300
資金過不足		-4,400
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-500	
国債補完供給	+36,400	
金融調節合計		+35,900
当座預金増減		+31,500

<4月8日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残560兆9,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<4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	5,654,500	+76,500
+40,000	5,649,500	+71,500
+35,000	5,644,500	+66,500
+30,000	5,639,500	+61,500
+25,000	5,634,500	+56,500
+20,000	5,629,500	+51,500
+15,000	5,624,500	+46,500
+10,000	5,619,500	+41,500
+5,000	5,614,500	+36,500
± 0	5,609,500	+31,500
-5,000	5,604,500	+26,500
-10,000	5,599,500	+21,500
-15,000	5,594,500	+16,500
-20,000	5,589,500	+11,500
-25,000	5,584,500	+6,500
-30,000	5,579,500	+1,500
-35,000	5,574,500	-3,500
-40,000	5,569,500	-8,500
-45,000	5,564,500	-13,500

<4月5日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 4/ 5-24/ 4/ 8	応札 36,829億 落札 36,829億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 4/ 5-24/ 4/ 8	応札 0億 落札 0億

<4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		11,016		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		1,001		
4/ 3~ 4/17	8,005.	3/29(3-5Y)	4,252.	33,473		864,191		5/17~ 5/17	0.	
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	3/29(5-10Y)	4,754.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	6/19~ 6/19	63,179.	8/19~ 8/19	381.	
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	3/29(10-25Y)	1,505.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.	11/18~11/18	93.	
1/10~ 1/10	20,011.	3/29(物国)	600.	12/ 2~12/ 2	1,712.	12/15~12/13	54,701.	2/17~ 2/17	346.	
1/13~ 1/14	20,008.	4/ 4(-1Y)	1,501.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	3/17~ 3/17	64,498.	5/12~ 5/12	181.	
1/16~ 1/16	20,009.	4/ 4(1-3Y)	3,754.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.	※直近約1年分の期落ち分を記載		8/18~ 8/18	0.	
1/19~ 1/20	1,163.	4/ 4(3-5Y)	4,257.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.	米ドル資金供給オペ		11/17~11/17	0.	
		4/ 4(10-25Y)	1,504.	12/ 1~12/ 1	2,464.	0百万ドル		2/16~ 2/16	0.	
				3/ 2~ 3/ 2	7,922.	4/ 4~ 4/11		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						
				16,370百万ドル						
				6/ 2~ 6/ 3	5,566.			気候変動対応支援資金供給		
				9/ 5~ 9/ 5	5,382.			81,666		
				12/ 4~12/ 4	3,325.			7/21~ 7/19		34,398.
				3/ 4~ 3/ 4	2,097.			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				
						国債短期証券買入額(月初来)				
				国債売現先オペ		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.				
				※直近約1週間の実施分を記載						
				国債補完供給		36,829				
				4/ 5~ 4/ 8		36,829.				
				4/ 5~ 4/ 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.				
				※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						
				※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						
				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.				
				※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						
				※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						
				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.				
				※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						
				※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						
				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.				
				※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						
				※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						
				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.				
				※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						
				※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						
				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.				
				※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						
				※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						
				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.				
				※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						
				※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						
				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.				
				※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						
				※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						
				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				