

東京短資デイリーレポート

2024/7/10

<7月9日のマナリーベース>

6,715,700

<7月10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	5,459,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,461,600
日銀当座預金残高増減前日比	-2,600

<7月10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		+1,100
財政等要因		-18,400
資金過不足		-17,300
金融調節		
共通担保(全店)	期落	新規
	-8,000	+8,000
CP等買入		-700
社債等買入		-300
国債補充供給		+22,300
金融調節合計		-500
当座預金増減-②		-17,800

<7月10日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,443,800
準備預金残高	4,834,000
積み終了先	4,833,900
超過準備	4,833,900
非準備先残高	609,800

<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)	100
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	83.3
進捗率乖離幅	+16.6

<7月11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		-9,400
資金過不足		-8,500
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
		+12,900
CP等買入		-300
社債等買入		-100
国債補充供給		+21,800
金融調節合計		+34,300
当座預金増減		+25,800

<7月11日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆9,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月11日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,514,600	+70,800
+40,000	5,509,600	+65,800
+35,000	5,504,600	+60,800
+30,000	5,499,600	+55,800
+25,000	5,494,600	+50,800
+20,000	5,489,600	+45,800
+15,000	5,484,600	+40,800
+10,000	5,479,600	+35,800
+5,000	5,474,600	+30,800
±0	5,469,600	+25,800
-5,000	5,464,600	+20,800
-10,000	5,459,600	+15,800
-15,000	5,454,600	+10,800
-20,000	5,449,600	+5,800
-25,000	5,444,600	+800
-30,000	5,439,600	-4,200
-35,000	5,434,600	-9,200
-40,000	5,429,600	-14,200
-45,000	5,424,600	-19,200

<7月10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)	24/ 7/11	3,750億 応札 9,504億 落札 3,752億 最低 -0.018% 平均 -0.011% 按分 5.9%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 7/11	4,250億 応札 8,096億 落札 4,252億 最低 -0.013% 平均 -0.006% 按分 29.7%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 7/11	4,250億 応札 9,267億 落札 4,257億 最低 +0.010% 平均 +0.012% 按分 84.2%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/ 7/11	750億 応札 2,120億 落札 753億 最低 +0.025% 平均 +0.030% 按分 49.5%
(11:50) 国債補充供給	24/ 7/10-24/ 7/11	応札 22,413億 落札 22,413億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補充供給	24/ 7/10-24/ 7/11	応札 1億 落札 1億 全取 -0.150% 平均 -0.150%

<7月10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	99,226	国債買入額(月初末)	18,123	成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		被災地金融機関支援資金供給	1,001
7/10~ 7/24	8,005.	7/ 4(-1Y)	1,500.	3	1,523	8	68,658	8/19~ 8/19	381.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	7/ 4(1-3Y)	3,754.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	9/16~ 9/13	132,310.	11/18~11/18	93.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	7/ 4(3-5Y)	4,255.	12/ 2~12/ 2	1,712.	12/15~12/13	54,701.	2/17~ 2/17	346.
1/10~ 1/10	20,011.	7/ 4(10-25Y)	1,504.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	3/17~ 3/17	64,498.	5/17~ 5/12	0.
1/13~ 1/14	20,008.	(7/11(1-3Y)	3,752.)	6/ 2~ 6/ 2	2,644.	6/18~ 6/18	26,498.	5/12~ 5/12	181.
1/16~ 1/16	20,009.	(7/11(3-5Y)	4,252.)	9/ 1~ 9/ 1	5,024.			8/18~ 8/18	0.
1/19~ 1/20	1,163.	(7/11(5-10Y)	4,257.)	12/ 1~12/ 1	2,464.			11/17~11/17	0.
		(7/11(25Y-)	753.)	3/ 2~ 3/ 2	7,922.	※直近約1年分の期落ち分を記載		2/16~ 2/16	0.
				6/ 3~ 6/ 3	3,160.	米ドル資金供給オペ			
						0百万ドル			
						7/ 5~ 7/11	0.		
						(7/11~ 7/18	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			
						16,122百万ドル			
						9/ 5~ 9/ 5	5,382.		
						12/ 4~12/ 4	3,325.		
						3/ 4~ 3/ 4	2,097.		
						6/ 3~ 6/ 3	5,318.		
						国債買現先オペ			
						0			
						国債売現先(米ドルオペ用担保)			
						0			
						国庫短期証券買入額(月初末)			
						0			
						国債売現先オペ			
						0			
						※直近約1週間の実施分を記載			
						国債買入額(固定利回)(月初末)			
						0			
						国債補充供給			
						22,414			
						7/10~ 7/11	22,413.		
						7/10~ 7/11	1.		
						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			
						※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10日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	NCD/CP買現先	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N	+0.070	1M +0.220000	3M 買気配 +0.020
1W	売気配 +0.070	2M +0.280000	6M 買気配 +0.020
2W	売気配 +0.070	3M -----	1Y 買気配 +0.150
1M	売気配 +0.070		

<7月9日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,841	+95
有担保	41,044	+32
無担保	79,797	+63

<7月10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	0.055	0.150	0.077	±0					0.083	+0.029
トムネ				-----					0.076	+0.007
スポネ				-----						
1週間物			0.075	-----					0.055	+0.001
2週間物			0.210	-----					0.054	+0.002
3週間物	0.150	0.170	0.157	-----					0.056	+0.003
1ヶ月物			0.165	-----					0.056	+0.003
3ヶ月物				-----					0.089	+0.001
6ヶ月物				-----					0.142	±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