

東京短資デイリーレポート

2024/7/24

<7月23日のマネタリーベース>

6,698,800

<7月24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	5,489,100	
前日の日銀当座預金残高-①	5,453,400	
日銀当座預金残高増減前日比	+35,700	

<7月24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		0
財政等要因		-3,300
資金過不足		-3,300
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+12,200
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
CP等買入	-200	
社債等買入		+700
国債補完供給	+20,800	-22,000
金融調節合計		+11,500
当座預金増減-②		+8,200

<7月24日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,461,600
準備預金残高	4,868,300
積み終了先	4,867,100
超過準備	4,867,000
非準備先残高	593,300

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,082,100
今積み期間所要準備額(平均)	131,700
残り要積立額(積数)	6,200
残り要積立額(平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	29.0
進捗率乖離幅	+70.8

<7月25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		-500
財政等要因		+6,500
資金過不足		+6,000
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-300	
国債補完供給	+22,000	
金融調節合計		+21,600
当座預金増減		+27,600

<7月25日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆9,200億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<7月25日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,534,200	+72,600
+40,000	5,529,200	+67,600
+35,000	5,524,200	+62,600
+30,000	5,519,200	+57,600
+25,000	5,514,200	+52,600
+20,000	5,509,200	+47,600
+15,000	5,504,200	+42,600
+10,000	5,499,200	+37,600
+5,000	5,494,200	+32,600
±0	5,489,200	+27,600
-5,000	5,484,200	+22,600
-10,000	5,479,200	+17,600
-15,000	5,474,200	+12,600
-20,000	5,469,200	+7,600
-25,000	5,464,200	+2,600
-30,000	5,459,200	-2,400
-35,000	5,454,200	-7,400
-40,000	5,449,200	-12,400
-45,000	5,444,200	-17,400

<7月24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。

(11:50) 国債補完供給	24/ 7/24-24/ 7/25	応札 22,706億 落札 22,706億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 7/24-24/ 7/25	応札 0億 落札 0億

<7月24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
9 9,228	5 2,914	成長基盤強化支援資金供給	1,001
		貸出増加支援資金供給	
7/24~ 8/ 7 8,007.	7/18(1-3Y) 3,755.	3 1,523	8/19~ 8/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	7/18(5-10Y) 4,257.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	7/18(10-25Y) 1,501.	12/ 2~12/ 2 1,712.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	7/24(1-3Y) 3,754.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008.	7/24(3-5Y) 4,255.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.	7/24(5-10Y) 4,255.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.		12/ 1~12/ 1 2,464.	11/17~11/17 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	2/16~ 2/16 0.
		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	
		3百万ドル	
		7/18~ 7/25 3.	
		(7/25~ 8/ 1 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	
		1 6,122百万ドル	
		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)	
		2	
		7/24~ 8/ 2 2.	
		国庫短期証券買入額(月初来)	
		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)(月初来)	
		0	
		国債補完供給	
		2 2,706	
		7/24~ 7/25 22,706.	
		7/24~ 7/25 0.	
		ETF買入額	
		3 56,921	
		約定 23/10/ 4 701.	
		ETF買入額(企業支援)	
		1 4,628	
		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	
		共通担保(全店)金利入札	
		7 0,035	
		1/24~ 1/24 10,003.	
		2/ 1~ 2/ 1 10,004.	
		2/15~ 2/15 10,004.	
		3/ 1~ 3/ 1 10,010.	
		9/15~ 9/15 10,005.	
		10/10~10/10 10,006.	
		10/25~10/25 10,003.	
		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24日 オープン市場気配レート(単位:%)>	
		NCD/CP現先	
S/N	+0.070	1M	+0.320000
1W	売気配 +0.070	2M	+0.250000
2W	売気配 +0.070	3M	+0.280000
1M	売気配 +0.070	1Y	買気配 +0.180
		CPプライマリ	
		TBアウトライト	
		買気配 +0.050	
		買気配 +0.050	
		買気配 +0.180	
		<7月23日のコール市場残高(単位:億円)>	
		残高	増減
市場合計	118,911		-1,342
有担保	37,978		-1,045
無担保	80,933		-297
		<7月24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
翌日物	0.070	0.125	0.080
トムネ			-----
スボネ			-----
1週間物	0.078	0.220	0.107
2週間物			-----
3週間物			-----
1ヶ月物			-----
3ヶ月物			-----
6ヶ月物			-----
1年物			-----
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比
		平均	前日比

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