

東京短資デイリーレポート

2023/4/11

<4月10日のマネタリーベース>

6,693,800

<4月11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	5,494,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,429,900
日銀当座預金残高増減前日比	+64,600

<4月11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		-7,300
資金過不足		-6,700
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+14,600
CP等買入	-300	
国債補完供給	+54,400	-48,400
金融調節合計		+20,300
当座預金増減-②		+13,600

<4月11日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,443,500
準備預金残高	4,749,200
積み終了先	4,749,200
超過準備	4,749,200
非準備先残高	694,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,918,900
今積み期間所要準備額 (平均)	126,400
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(%)	87.1
進捗率乖離幅	+12.8

<4月12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		+200
財政等要因		-27,200
資金過不足		-27,000
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
CP等買入	-400	
国債補完供給	+48,400	
金融調節合計		+49,000
当座預金増減		+22,000

<4月12日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆5,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.010%~-0.005% での合いが中心か。

<4月12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	5,510,500	+67,000
+40,000	5,505,500	+62,000
+35,000	5,500,500	+57,000
+30,000	5,495,500	+52,000
+25,000	5,490,500	+47,000
+20,000	5,485,500	+42,000
+15,000	5,480,500	+37,000
+10,000	5,475,500	+32,000
+5,000	5,470,500	+27,000
± 0	5,465,500	+22,000
-5,000	5,460,500	+17,000
-10,000	5,455,500	+12,000
-15,000	5,450,500	+7,000
-20,000	5,445,500	+2,000
-25,000	5,440,500	-3,000
-30,000	5,435,500	-8,000
-35,000	5,430,500	-13,000
-40,000	5,425,500	-18,000
-45,000	5,420,500	-23,000

<4月11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(国)(5Y-10Y)	23/ 4/12	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.040%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 4/12	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.206%
(10:10) 国庫短期証券買入	23/ 4/12	1,000億	応札	6,050億	落札	1,000億	全取 +0.024% 平均 +0.024%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 4/13-23/ 4/20	応札	0m1	落札	0m1	貸付	5.080%
(11:50) 国債補完供給	23/ 4/11-23/ 4/12	応札	785億	落札	785億	全取 -1.100% 平均 -1.375%	
(11:50) 国債補完供給	23/ 4/11-23/ 4/12	応札	47,614億	落札	47,614億	全取 -0.350% 平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 4/11-23/ 4/12	応札	200億	落札	200億	全取 -0.350% 平均 -0.350%	

<4月11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(月初末)	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
99,476	27,793			1,716
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	4/ 6(-1Y) 1,501.	52,200	722,786	5/14~ 5/12 300.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	4/ 6(1-3Y) 4,257.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.	6/11~ 5/12 596.
1/10~ 1/10 20,011.	4/ 6(3-5Y) 5,004.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.	8/20~ 8/18 0.
1/13~ 1/14 20,008.	4/ 6(10-25Y) 2,509.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.	11/19~11/17 0.
1/16~ 1/16 20,009.	4/11(1-3Y) 4,252.	9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.
1/19~ 1/20 1,163.	4/11(5-10Y) 6,764.	12/ 4~12/ 4 10,258.		5/17~ 5/17 0.
4/ 5~ 4/19 8,255.	4/11(10-25Y) 2,504.	6/ 4~ 3/ 4 2,178.		8/19~ 8/19 381.
	4/11(25Y) 1,002.	3/ 3~ 6/ 3 1,950.		11/18~11/18 93.
		9/ 2~ 9/ 2 1,804.		2/17~ 2/17 346.
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			4/ 5~ 4/12 0.	
			4/ 6~ 4/13 0.	
			成長基盤強化支援米ドル特別	
			4/ 7~ 4/14 0.	
			17,709百万ドル	
			4/10~ 4/17 0.	
			6/ 3~ 6/ 2 5,848.	
			9/ 2~ 9/ 5 6,101.	(4/12~ 4/19 0.)
			12/ 2~12/ 4 3,607.	(4/13~ 4/20 0.)
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
			国債買入先オペ	
			0	
			新型コロナ企業金融支援	
			59,810	
			1/27~ 4/27 2,514.	
			2/28~ 5/26 5,355.	
			3/31~ 6/30 51,941.	
			国債売入先オペ	
			0	
			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.	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			(4/13 3,995.)	
			CP買入額(月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			1,000	
			4/ 6 1,000.	
			(4/12 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	

※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11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 -----	3M 買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M +0.015000	6M 買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020		

<4月10日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	194,127	+358
有担保	26,371	-1,153
無担保	167,756	+1,511

<4月11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	0.001	-0.007	-0.001				-----	-0.102	+0.014
トムネ				-----				-----	-0.120	+0.029
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.040	-0.005	-0.032	-0.025				-----	-0.160	+0.004
2週間物	-0.018	-0.008	-0.014	-0.010				-----	-0.165	+0.004
3週間物				-----				-----	-0.172	+0.002
1ヶ月物				-----				-----	-0.177	± 0
3ヶ月物				-----				-----	-0.175	+0.003
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