

# 東京短資デیلیーレポート

2023/5/18

## <5月17日のマネタリーベース>

6,693,000
-----------

## <5月18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	5,445,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,430,600
日銀当座預金残高増減前日比	+14,700

## <5月18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	+300	
財政等要因	-11,200	
資金過不足	-10,900	
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補完供給	+25,500	-25,600
金融調節合計		-200
当座預金増減-②		-11,100

## <5月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,419,500
準備預金残高	4,724,800
積み終了先	4,707,400
超過準備	4,692,700
非準備先残高	694,700

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,008,700
今積み期間所要準備額(平均)	129,300
残り要積立額(積数)	52,400
残り要積立額(平均)	1,900
準備進捗率(%)	98.6
日数進捗率(%)	9.7
進捗率乖離幅	+88.9

## <5月19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	+700	
財政等要因	+4,900	
資金過不足	+5,600	
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+16,000
CP等買入	-500	
社債等買入	-500	
国債補完供給	+25,600	
金融調節合計		+40,600
当座預金増減		+46,200

## <5月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆5,700億円)で 無担保コール0/Nは-0.050%~-0.020% での出会いが中心か。
--

## <5月19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	5,510,700	+91,200
+40,000	5,505,700	+86,200
+35,000	5,500,700	+81,200
+30,000	5,495,700	+76,200
+25,000	5,490,700	+71,200
+20,000	5,485,700	+66,200
+15,000	5,480,700	+61,200
+10,000	5,475,700	+56,200
+5,000	5,470,700	+51,200
± 0	5,465,700	+46,200
-5,000	5,460,700	+41,200
-10,000	5,455,700	+36,200
-15,000	5,450,700	+31,200
-20,000	5,445,700	+26,200
-25,000	5,440,700	+21,200
-30,000	5,435,700	+16,200
-35,000	5,430,700	+11,200
-40,000	5,425,700	+6,200
-45,000	5,420,700	+1,200

## <5月18日 日銀オペ入札結果>

(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	23/ 5/19	4,250億	応札 7,104億	落札 4,251億	最低 +0.003%	平均 +0.005%	按分 63.3%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 5/19	5,000億	応札 11,077億	落札 5,007億	最低 0.000%	平均 +0.001%	按分 63.7%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 5/19	5,750億	応札 14,080億	落札 5,757億	最低 +0.011%	平均 +0.013%	按分 31.4%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/ 5/19	1,000億	応札 4,107億	落札 1,002億	最低 +0.023%	平均 +0.023%	按分 96.0%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 5/19		応札 0億	落札 0億	固定利回較差 +0.140%		
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 5/19		応札 0億	落札 0億	固定利回較差 +0.330%		
(10:40) 社債買入	23/ 5/23	1,000億	応札 2,214億	落札 1,000億	最低 +0.216%	平均 +0.232%	按分 27.3%
(11:50) 国債補完供給	23/ 5/18-23/ 5/19		応札 25,496億	落札 25,496億	全取 -0.350%	平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 5/18-23/ 5/19		応札 0億	落札 0億			

## <5月18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)		貸出増加支援資金供給		被災地金融機関支援資金供給	
9 9 , 1 6 6		2 6 , 2 9 2		1 7 , 7 0 9 百万ドル		1 0 0 1	
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	5/15(25Y-)	1,002.	5 2 , 2 0 0	7 2 2 , 7 8 6	8/20~ 8/18	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	5/15(1-3Y)	4,251.	6/ 4~ 6/ 2	4,312.	6/19~ 6/19	28,033.
1/10~ 1/10	20,011.	5/15(5-10Y)	6,265.	6/ 5~ 6/ 5	5.	9/17~ 9/15	13,014.
1/13~ 1/14	20,008.	5/15(10-25Y)	2,005.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	12/16-12/15	20,601.
1/16~ 1/16	20,009.	(5/19(1-3Y)	4,251.)	9/ 4~ 9/ 4	34.	3/18~ 3/18	41,458.
1/19~ 1/20	1,163.	(5/19(3-5Y)	5,007.)	12/ 4~12/ 4	10,258.		
5/10~ 5/24	7,945.	(5/19(5-10Y)	5,757.)	6/ 3~ 3/ 4	2,178.		
		(5/19(25Y-)	1,002.)	3/ 3~ 6/ 3	1,950.		
				9/ 2~ 9/ 2	1,804.		
				※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 7 , 7 0 9 百万ドル			
				6/ 3~ 6/ 2		5,848.	
				9/ 2~ 9/ 5		6,101.	
				12/ 2~12/ 4		3,607.	
				3/ 3~ 3/ 4		2,153.	
国債補完供給							
2 5 , 4 9 6							
5/18~ 5/19				25,496.			
5/18~ 5/19				0.			
国債売現先(米ドルオペ用担保)				0		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			
国庫短期証券買入額(月初来)				2,002			
5/12				1,001.			
5/17				1,001.			
C P 買入額(月初来)				3,995			
5/16				3,995.			
ETF買入額				3 5 6 , 2 2 0			
約定 23/ 3/14				701.			
ETF買入額(企業支援)				1 4 , 6 2 8			
約定 21/ 3/31				12.			
J-REIT買入額				6 , 8 2 3			
約定 22/ 6/14				12.			
				※直近約1週間の実施分を記載			
		米ドルオペ用担保		国債買現先		99,166	
		米ドルオペ用担保		0		CP等買入(推定)	
		米ドルオペ用担保		0		79,300	
		米ドルオペ用担保		1,001		社債等買入(推定)	
		米ドルオペ用担保		44,214			
		米ドルオペ用担保		47,971		成長基盤強化支援	
		米ドルオペ用担保		650,943		手形売出	
		米ドルオペ用担保		57,296		0	
		米ドルオペ用担保		900,591		国債買現先	
		米ドルオペ用担保		0		25,496	
		米ドルオペ用担保		0		国債補完供給	
		米ドルオペ用担保		900,591		0	
		米ドルオペ用担保		875,095		吸収額合計	
		米ドルオペ用担保				25,496	
		米ドルオペ用担保				差し引き	

※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。

## <5月18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	-----	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				

## <5月17日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	181,801	-1,980
有担保	26,537	-2,061
無担保	155,264	+81

## <5月18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	-0.087	0.001	-0.034	-0.001					-0.093	+0.002
トムネ									-0.102	-0.002
スポネ										
1週間物	-0.025	-0.003	-0.021	+0.021					-0.124	-0.001
2週間物			-0.035	-0.013					-0.136	-0.002
3週間物			-0.005	+0.020					-0.144	± 0
1ヶ月物	-0.030	0.080	-0.011	+0.018					-0.151	-0.001
3ヶ月物									-0.157	-0.001
6ヶ月物									-0.130	± 0
1年物									-0.102	± 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現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