

# 東京短資デイリーレポート

2024/5/14

## <5月13日のマネタリーベース>

6,770,000
-----------

## <5月14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	5,559,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,519,600
日銀当座預金残高増減前日比	+39,600

## <5月14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		+1,500
財政等要因		-3,400
資金過不足		-1,900
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+9,400
CP等買入	-400	
国債補充供給	+35,200	-33,900
金融調節合計		+10,300
当座預金増減-②		+8,400

## <5月14日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,528,000
準備預金残高	4,880,200
積み終了先	4,880,200
超過準備	4,880,200
非準備先残高	647,800

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,961,600
今積み期間所要準備額 (平均)	132,100
残り要積立額 (積数)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	96.7
進捗率乖離幅	+3.3

## <5月15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		+1,100
財政等要因		-25,300
資金過不足		-24,200
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-6,500	+7,000
CP等買入	-500	
国債補充供給	+33,900	
金融調節合計		+33,900
当座預金増減		+9,700

## <5月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残553兆7,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。
---

## <5月15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	5,582,700	+54,700
+40,000	5,577,700	+49,700
+35,000	5,572,700	+44,700
+30,000	5,567,700	+39,700
+25,000	5,562,700	+34,700
+20,000	5,557,700	+29,700
+15,000	5,552,700	+24,700
+10,000	5,547,700	+19,700
+5,000	5,542,700	+14,700
± 0	5,537,700	+9,700
-5,000	5,532,700	+4,700
-10,000	5,527,700	-300
-15,000	5,522,700	-5,300
-20,000	5,517,700	-10,300
-25,000	5,512,700	-15,300
-30,000	5,507,700	-20,300
-35,000	5,502,700	-25,300
-40,000	5,497,700	-30,300
-45,000	5,492,700	-35,300

## <5月14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。

(10:40) 米ドル資金供給	24/ 5/16-24/ 5/23	応札 1m1l 落札 1m1l	貸付 5.580%
(10:40) CP買入	24/ 5/17	3,000億 応札 6,970億 落札 2,995億	最低 +0.154% 平均 +0.176% 按分 93.6%
(11:50) 国債補充供給	24/ 5/14-24/ 5/15	応札 34,748億 落札 34,748億	全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:00) 共通担保(全店)	24/ 5/15-24/ 5/29	8,000億 応札 6,960億 落札 6,960億	貸付 0.100%
(13:50) 国債補充供給	24/ 5/14-24/ 5/15	応札 0億 落札 0億	

## <5月14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
97,731	20,536	33,473	864,191	1,001
5/ 1~ 5/15 6,510.	5/ 8(-1Y) 1,502.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	5/17~ 5/17 0.
( 5/15~ 5/29 6,960.)	5/ 8(1-3Y) 3,752.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	8/19~ 8/19 381.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	5/ 8(3-5Y) 4,256.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	11/18~11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	5/ 8(10-25Y) 1,507.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	5/14(1-3Y) 3,760.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.	5/14(5-10Y) 4,257.	12/ 1~12/ 1 2,464.	5/16~ 5/23 1.)	8/18~ 8/18 0.
1/16~ 1/16 20,009.	5/14(10-25Y) 1,502.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	5/ 9~ 5/16 1.	11/17~11/17 0.
1/19~ 1/20 1,163.			( 5/16~ 5/23 1.)	2/16~ 2/16 0.
			1百万ドル	
			5/ 9~ 5/16 1.	
			( 5/16~ 5/23 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	
			16,370百万ドル	
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.	
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.	
			12/ 4~12/ 4 3,325.	
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
			国債買現先オペ	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			2	
			5/ 8~ 5/17 2.	
			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	
			34,748	
			5/14~ 5/15 34,748.	
			5/14~ 5/15 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	
			CP買入額(月初末)	
			0	
			( 5/17 2,995.)	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			成長基盤強化支援	
			28,711	
			貸出増加支援	
			782,979	
			供給オペ合計	
			1,062,120	
			貸出(推定)	
			0	
			供給額合計	
			1,062,120	
			国債補充供給	
			34,748	
			国債売現先	
			0	
			国債売現先(米ドル担保)	
			2	
			吸収額合計	
			34,750	
			差し引き	
			1,027,370	

※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14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 +0.070	1M +0.115000	3M 買気配 +0.060
1W 売気配 +0.070	2M +0.125000	6M 買気配 +0.120
2W 売気配 +0.070	3M +0.149000	1Y 買気配 +0.200
1M 売気配 +0.070		

## <5月13日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,043	+3,985
有担保	36,910	-736
無担保	83,133	+4,721

## <5月14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	0.070	0.078	0.077	± 0					0.076	-0.003
トムネ				-----					0.080	+0.001
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.068	± 0
2週間物			0.170	-0.003					0.061	-0.001
3週間物			0.140	-0.030					0.059	± 0
1ヶ月物				-----					0.058	± 0
3ヶ月物			0.190	-----					0.063	± 0
6ヶ月物				-----					0.087	+0.002
1年物				-----					0.129	+0.004

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