

# 東京短資デイリーレポート

2024/5/21

## <5月20日のマナタリーベース>

6,762,700
-----------

## <5月21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	5,546,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,517,200
日銀当座預金残高増減前日比	+29,300

## <5月21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	-2,700
資金過不足	-2,100
金融調節	
CP等買入	-100
国債補充供給	+30,900
金融調節合計	±0
当座預金増減-②	-2,100

## <5月21日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,515,100
準備預金残高	4,863,600
積み終了先	4,861,800
超過準備	4,861,600
非準備先残高	651,500

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,079,800
今積み期間所要準備額(平均)	131,600
残り要積立額(積数)	17,900
残り要積立額(平均)	700
準備進捗率(%)	99.5
日数進捗率(%)	19.4
進捗率乖離幅	+80.1

## <5月22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	+400
財政等要因	0
資金過不足	+400
金融調節確定分	
CP等買入	-800
社債等買入	-100
国債補充供給	+30,800
金融調節合計	+29,900
当座預金増減	+30,300

## <5月22日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残554兆5,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。
---

## <5月22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	5,590,400	+75,300
+40,000	5,585,400	+70,300
+35,000	5,580,400	+65,300
+30,000	5,575,400	+60,300
+25,000	5,570,400	+55,300
+20,000	5,565,400	+50,300
+15,000	5,560,400	+45,300
+10,000	5,555,400	+40,300
+5,000	5,550,400	+35,300
±0	5,545,400	+30,300
-5,000	5,540,400	+25,300
-10,000	5,535,400	+20,300
-15,000	5,530,400	+15,300
-20,000	5,525,400	+10,300
-25,000	5,520,400	+5,300
-30,000	5,515,400	+300
-35,000	5,510,400	-4,700
-40,000	5,505,400	-9,700
-45,000	5,500,400	-14,700

## <5月21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) 社債買入	24/ 5/24	750億	応札 1,646億	落札 750億	最低 +0.587%	平均 +0.607%	按分 14.3%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 5/23-24/ 5/30		応札 0m1	落札 0m1	貸付 5.580%		
(11:50) 国債補充供給	24/ 5/21-24/ 5/22		応札 31,587億	落札 31,587億	全取 -0.150%	平均 -0.150%	
(13:50) 国債補充供給	24/ 5/21-24/ 5/22		応札 0億	落札 0億			

## <5月21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
9 8, 1 8 1	3 3, 5 5 1			1, 0 0 1
5/15~ 5/29 6,960.	5/14(1-3Y) 3,760.	3 3, 4 7 3	8 6 4, 1 9 1	8/19~ 8/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	5/14(5-10Y) 4,257.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	5/14(10-25Y) 1,502.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	5/20(1-3Y) 3,751.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008.	5/20(3-5Y) 4,254.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.	5/20(5-10Y) 4,257.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	5/20(25Y-) 753.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.		2/16~ 2/16 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.		
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			1 百万ドル	
			5/16~ 5/23 1.	
			(5/23~ 5/30 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	
			1 6, 3 7 0 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)
				0
				国債短期証券買入額(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
				3 1, 5 8 7
				5/21~ 5/22 31,587.
				5/21~ 5/22 0.
				ETF買入額
				3 5 6, 9 2 1
				約定 23/10/ 4 701.
				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
				C P 買入額(月初末)
				2, 9 9 5
				5/17 2,995.
				社債買入額(月初末)
				0
				(5/24 750.)
				<5月21日 日銀信用概算(除く買切)>
				共通担保(全)固定 98,181 CP等買入(推定) 22,600
				共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 59,000
				国債買現先 0
				被災地金融機関支援 1,001
				気候変動対応支援 81,663
				成長基盤支援 28,711 手形売切 0
				貸出増加支援 782,979 国債売現先 0
				供給オペ合計 1,062,570 国債補充供給 31,587
				貸出(推定) 0 国債売現先(米ドル担保) 0
				供給額合計 1,062,570 吸収額合計 31,587
				差し引き 1,030,983

※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21日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	1M	3M	1M	3M	3M	6M
	+0.070		+0.135000		買気配 +0.050	
1W	売気配 +0.070		-----		買気配 +0.150	
2W	売気配 +0.070		+0.173000		買気配 +0.150	
1M	売気配 +0.070					

## <5月20日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,333	+3,141
有担保	37,862	-37
無担保	77,471	+3,178

## <5月21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	0.078	0.077	±0				-----	0.042	-0.041
トムネ				-----				-----	0.045	-0.035
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.058	-0.008
2週間物	0.150	0.160	0.153	-----				-----	0.057	-0.005
3週間物				-----				-----	0.057	-0.003
1ヶ月物	0.110	0.150	0.147	-----				-----	0.057	-0.001
3ヶ月物			0.180	-0.042				-----	0.075	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.098	+0.001
1年物				-----				-----	0.167	+0.007

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