

# 東京短資デイリーレポート

2024/5/28

## <5月27日のマネタリーベース>

6,768,300
-----------

## <5月28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	5,561,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,524,600
日銀当座預金残高増減前日比	+36,700

## <5月28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		+500
財政等要因		+10,000
資金過不足		+10,500
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-600	
国債補完供給	+28,000	-28,700
金融調節合計		-1,300
当座預金増減-②		+9,200

## <5月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,533,800
準備預金残高	4,877,300
積み終了先	4,876,300
超過準備	4,876,300
非準備先残高	656,500

## <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)	6,900
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+57.9

## <5月29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		-7,500
資金過不足		-7,300
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-7,000	+7,200
CP等買入	-500	
国債補完供給	+28,700	
金融調節合計		+28,400
当座預金増減		+21,100

## <5月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残555兆4,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。
---

## <5月29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	5,599,900	+66,100
+40,000	5,594,900	+61,100
+35,000	5,589,900	+56,100
+30,000	5,584,900	+51,100
+25,000	5,579,900	+46,100
+20,000	5,574,900	+41,100
+15,000	5,569,900	+36,100
+10,000	5,564,900	+31,100
+5,000	5,559,900	+26,100
±0	5,554,900	+21,100
-5,000	5,549,900	+16,100
-10,000	5,544,900	+11,100
-15,000	5,539,900	+6,100
-20,000	5,534,900	+1,100
-25,000	5,529,900	-3,900
-30,000	5,524,900	-8,900
-35,000	5,519,900	-13,900
-40,000	5,514,900	-18,900
-45,000	5,509,900	-23,900

## <5月28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/ 5/30-24/ 6/ 6	応札 0m1 落札 0m1	貸付 5.580%
(10:40) CP買入	24/ 5/31	3,000億 応札 6,196億 落札 2,995億	最低 +0.161% 平均 +0.177% 按分 97.5%
(11:50) 国債補完供給	24/ 5/28-24/ 5/29	応札 29,530億 落札 29,530億	全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 5/29-24/ 6/12	8,000億 応札 7,159億 落札 7,159億	貸付 0.100%
(13:50) 国債補完供給	24/ 5/28-24/ 5/29	応札 10億 落札 10億	全取 -0.250% 平均 -0.250%

## <5月28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
9,818.1	45,625	成長基盤強化支援資金供給	1,001
5/15~ 5/29 6,960.	5/24(1-3Y) 3,564.	33,473	8/19~ 8/19 381.
(5/29~ 6/12 7,159.)	5/24(3-5Y) 4,255.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	5/24(5-10Y) 4,255.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	2/17~ 2/17 346.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.		12/ 2~12/ 2 1,712.	5/17~ 5/12 0.
1/10~ 1/10 20,011.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/13~ 1/14 20,008.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.		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.
			0百万ドル
			5/23~ 5/30 0.
			(5/30~ 6/ 6 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
			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)
			0
			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
			29,540
			5/28~ 5/29 29,530.
			5/28~ 5/29 10.
			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(月初来)
			2,995
			5/17 2,995.
			(5/31 2,995.)
			社債買入額(月初来)
			750
			5/24 750.

## <5月28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)	20,700
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	58,900
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	手形売出	0
貸出増加支援	782,979	国債売現先	0
供給オペ合計	1,062,570	国債補完供給	29,540
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	29,540
		差し引き	1,033,030

※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28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 +0.116000	3M 買気配 +0.050
1W 売気配 +0.070	2M +0.125000	6M 買気配 +0.150
2W 売気配 +0.070	3M +0.180000	1Y 買気配 +0.250
1M 売気配 +0.070		

## <5月27日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	114,703	-3,460
有担保	38,996	-567
無担保	75,707	-2,893

## <5月28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	-0.001					0.045	-0.015
トムネ									0.041	-0.007
スポネ										
1週間物									0.055	-0.005
2週間物			0.150	±0					0.057	-0.003
3週間物									0.058	-0.002
1ヶ月物			0.160	+0.004					0.057	-0.002
3ヶ月物			0.200						0.082	+0.003
6ヶ月物									0.110	+0.003
1年物									0.193	+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