

東京短資デイリーレポート

2025/4/1

<3月31日のマネタリーベース>

6,537,900

<4月1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	5,289,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,304,600
日銀当座預金残高増減前日比	-14,900

<4月1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		+700
財政等要因		-22,300
資金過不足		-21,600
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+8,500	-5,700
金融調節合計		+2,800
当座預金増減-②		-18,800

<4月1日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,285,800
準備預金残高	4,790,600
積み終了先	4,789,700
超過準備	4,789,600
非準備先残高	495,200

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,121,700
今積み期間所要準備額 (平均)	133,000
残り要積立額 (積数)	1,900
残り要積立額 (平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	54.8
進捗率乖離幅	+45.1

<4月2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		-3,200
資金過不足		-2,800
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+5,700	
金融調節合計		+5,700
当座預金増減		+2,900

<4月2日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残528兆8,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での出合いが中心か。
--

<4月2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	5,333,700	+47,900
+40,000	5,328,700	+42,900
+35,000	5,323,700	+37,900
+30,000	5,318,700	+32,900
+25,000	5,313,700	+27,900
+20,000	5,308,700	+22,900
+15,000	5,303,700	+17,900
+10,000	5,298,700	+12,900
+5,000	5,293,700	+7,900
± 0	5,288,700	+2,900
-5,000	5,283,700	-2,100
-10,000	5,278,700	-7,100
-15,000	5,273,700	-12,100
-20,000	5,268,700	-17,100
-25,000	5,263,700	-22,100
-30,000	5,258,700	-27,100
-35,000	5,253,700	-32,100
-40,000	5,248,700	-37,100
-45,000	5,243,700	-42,100

<4月1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	25/ 4/ 3-25/ 4/10	応札 0m1l 落札 0m1l	貸付 4.580%
(11:50) 国債補完供給	25/ 4/ 1-25/ 4/ 2	応札 5,824億 落札 5,824億 全取 +0.250% 平均 +0.250%	
(13:00) 共通担保(全)固	25/ 4/ 2-25/ 4/16	8,000億 応札 15,208億 落札 8,005億	貸付 0.500% 按分 52.6%
(13:50) 国債補完供給	25/ 4/ 1-25/ 4/ 2	応札 0億 落札 0億	

<4月1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			
8,012		0		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給			
3/19~ 4/ 2 8,012. (4/ 2~ 4/16 8,005.)		3/25(1-3Y) 3,007. 3/25(3-5Y) 3,004. 3/25(5-10Y) 3,256. 3/25(25Y-) 753. 3/31(3-5Y) 3,002. 3/31(5-10Y) 3,252. 3/31(10-25Y) 1,503. 3/31(物国) 500.		21,214 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 3/ 4~ 3/ 4 830.		791,136 6/18~ 6/18 26,498. 6/19~ 6/18 67,646. 9/15~ 9/12 27,659. 9/13~ 9/12 121,454. 12/15~12/15 20,129. 12/13~12/15 33,838. 3/16~ 3/16 38,879. 3/17~ 3/16 18,695.		517 5/12~ 5/12 181. 5/17~ 5/12 0. 8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/17~11/17 0. 11/18~11/17 57. 2/16~ 2/16 0. 2/17~ 2/16 0.	
共通担保(全店)金利入札		※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則		※直近約1年分の期落ち分を記載 米ドル資金供給オペ					
70,035		8,651百万ドル		0百万ドル					
1/24~ 1/24 10,003. 2/ 1~ 2/ 1 10,004. 2/15~ 2/15 10,004. 3/ 1~ 3/ 1 10,010. 9/15~ 9/15 10,005. 10/10~10/10 10,006. 10/25~10/25 10,003.		6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830.		3/27~ 4/ 3 0. (4/ 3~ 4/10 0.)		気候変動対応支援資金供給 142,065 7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 69,704.			
国債補完供給		国債買現先オペ		国債売現先(米ドルオペ用担保)					
5,824		0		0					
4/ 1~ 4/ 2 5,824. 4/ 1~ 4/ 2 0.		0		0					
ETF買入額		国債売現先オペ		国庫短期証券買入額(月初来)					
356,921		0		0					
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)		0		0					
14,628		C P買入額(月初来)		0					
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額		0		0					
6,823		0		0					
約定 22/ 6/14 12.		0		0					
※直近約1週間の実施分を記載		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					
		0		0					

※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1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 売気配 +0.400	1M +0.515000	3M 買気配 +0.400
1W 売気配 +0.400	2M -----	6M 買気配 +0.500
2W 売気配 +0.400	3M +0.679000	1Y 買気配 +0.650
1M 売気配 +0.400		

<3月31日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	107,388	-11,518
有担保	32,450	-4,723
無担保	74,938	-6,795

<4月1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	0.450	0.478	0.477	+0.001			0.430	± 0	0.495	+0.309
トムネ				-----				-----	0.481	+0.029
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.484	0.650	0.551	-----				-----	0.445	+0.008
2週間物			0.550	± 0				-----	0.443	+0.003
3週間物			0.600	-0.010				-----	0.442	+0.002
1ヶ月物	0.550	0.560	0.557	-0.028				-----	0.442	+0.001
3ヶ月物	0.600	0.750	0.700	-----				-----	0.462	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.504	± 0
1年物				-----				-----	0.604	± 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