

# 東京短資デイリーレポート

2023/4/27

## <4月26日のマネタリーベース>

6,803,000
-----------

## <4月27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	5,555,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,532,100
日銀当座預金残高増減前日比	+23,000

## <4月27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	-2,900
財政等要因	+8,500
資金過不足	+5,600
金融調節	
CP等買入	期落 -200
社債等買入	-300
新型コロナ対応金融	-2,500
国債補完供給	+26,500
金融調節合計	-10,800
当座預金増減-②	-5,200

## <4月27日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,526,900
準備預金残高	4,807,400
積み終了先	4,805,800
超過準備	4,805,700
非準備先残高	719,500

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,846,600
今積み期間所要準備額 (平均)	128,200
残り要積立額 (積数)	10,600
残り要積立額 (平均)	600
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	40.0
進捗率乖離幅	+59.7

## <4月28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	-1,400
財政等要因	+3,900
資金過不足	+2,500
金融調節確定分	
国債買入	期落 +16,400
CP等買入	-2,900
社債等買入	-400
国債補完供給	+34,300
金融調節合計	+51,400
当座預金増減	+53,900

## <4月28日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残558兆800億円)で 無担保コール0/Nは-0.070%~-0.050% での合いが中心か。
---

## <4月28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	5,625,800	+98,900
+40,000	5,620,800	+93,900
+35,000	5,615,800	+88,900
+30,000	5,610,800	+83,900
+25,000	5,605,800	+78,900
+20,000	5,600,800	+73,900
+15,000	5,595,800	+68,900
+10,000	5,590,800	+63,900
+5,000	5,585,800	+58,900
±0	5,580,800	+53,900
-5,000	5,575,800	+48,900
-10,000	5,570,800	+43,900
-15,000	5,565,800	+38,900
-20,000	5,560,800	+33,900
-25,000	5,555,800	+28,900
-30,000	5,550,800	+23,900
-35,000	5,545,800	+18,900
-40,000	5,540,800	+13,900
-45,000	5,535,800	+8,900

## <4月27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。

(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 4/28	5,000億	応札 7,715億	落札 5,004億	最低 -0.007%	平均 -0.004%	按分 26.7%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 4/28	6,750億	応札 11,607億	落札 6,757億	最低 -0.004%	平均 -0.002%	按分 28.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 4/28	2,500億	応札 4,900億	落札 2,504億	最低 -0.008%	平均 -0.004%	按分 11.3%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/ 4/28	1,000億	応札 2,576億	落札 1,005億	最低 +0.005%	平均 +0.008%	按分 97.6%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 4/28		応札 0億	落札 0億	固定利回差	+0.045%	
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 4/28		応札 0億	落札 0億	固定利回差	+0.240%	
(10:10) 国債買入(物国)	23/ 4/28	600億	応札 1,972億	落札 600億	按分 -0.520円	平均 -0.520円	
(10:40) ミドル資金供給	23/ 5/ 1-23/ 5/11		応札 0mil	落札 0mil	貸付 5.110%		
(11:50) 国債補完供給	23/ 4/27-23/ 4/28		応札 34,384億	落札 34,384億	全取 -0.350%	平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 4/27-23/ 4/28		応札 0億	落札 0億			

## <4月27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)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
102,116	63,639	52,200	722,786	1,716
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	4/24(1-3Y) 4,255.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.	5/14~ 5/12 300.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	4/24(3-5Y) 5,005.	6/ 5~ 6/ 5 5.	6/11~ 5/12 596.	
1/10~ 1/10 20,011.	4/24(5-10Y) 6,755.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	9/17~ 9/15 13,014.	8/20~ 8/18 0.
1/13~ 1/14 20,008.	4/24(10-25Y) 2,502.	9/ 4~ 9/ 4 34.	12/16-12/15 20,601.	11/19-11/17 0.
1/16~ 1/16 20,009.	(4/28(3-5Y) 5,004.)	12/ 4~12/ 4 10,258.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.
1/19~ 1/20 1,163.	(4/28(5-10Y) 6,757.)	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	※直近約1年分の期落ち分を記載	5/17~ 5/17 0.
4/19~ 5/10 10,895.	(4/28(10-25Y) 2,504.)	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	米ドル資金供給オペ	8/19~ 8/19 381.
	(4/28(25Y-) 1,005.)	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	0百万ドル	11/18-11/18 93.
	(4/28(物国) 600.)		4/21~ 4/28 0.	2/17~ 2/17 346.
			4/24~ 5/ 1 0.	
			4/25~ 5/11 0.	
			4/26~ 5/11 0.	
			4/27~ 5/11 0.	
			(4/28~ 5/11 0.)	
			(5/ 1~ 5/11 0.)	
			新型コロナ企業金融支援	
			57,296	
			2/28~ 5/26 5,355.	
			3/31~ 6/30 51,941.	
			国債売現先オペ	
			0	
			国債売現先オペ	
			0	
			CP買入額(月初末)	
			3,995	
			4/13 3,995.	
			(4/28 3,995.)	
			社債買入額(月初末)	
			1,000	
			4/21 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	
			4/19 1,000.	
			4/26 1,000.	
			ETF買入額	
			356,220	
			約定 23/ 3/14 701.	
			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	
			国債買入額(固定利回) (月初末)	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			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	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			4,000	
			4/ 6 1,000.	
			4/12 1,000.	