

東京短資デイリーレポート

2023/5/8

<5月2日のマナリーベース>

6,784,700

<5月8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	5,513,100
前日の日銀当座預金残高(①)	5,508,200
日銀当座預金残高増減前日比	+4,900

<5月8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		+2,500
財政等要因		-33,100
資金過不足		-30,600
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-200	
国債補充供給	+31,600	-41,000
金融調節合計		-9,600
当座預金増減(②)		-40,200

<5月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,468,000
準備預金残高	4,775,200
積み終了先	4,774,600
超過準備	4,774,600
非準備先残高	692,800

<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)	1,600
残り要積立額(平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	76.7
進捗率乖離幅	+23.2

<5月9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		+2,900
財政等要因		-4,700
資金過不足		-1,800
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+12,800
CP等買入	-200	
国債補充供給	+41,000	
金融調節合計		+53,600
当座預金増減		+51,800

<5月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆9,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.080%~-0.060% での合いが中心か。

<5月9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	5,564,800	+96,800
+40,000	5,559,800	+91,800
+35,000	5,554,800	+86,800
+30,000	5,549,800	+81,800
+25,000	5,544,800	+76,800
+20,000	5,539,800	+71,800
+15,000	5,534,800	+66,800
+10,000	5,529,800	+61,800
+5,000	5,524,800	+56,800
±0	5,519,800	+51,800
-5,000	5,514,800	+46,800
-10,000	5,509,800	+41,800
-15,000	5,504,800	+36,800
-20,000	5,499,800	+31,800
-25,000	5,494,800	+26,800
-30,000	5,489,800	+21,800
-35,000	5,484,800	+16,800
-40,000	5,479,800	+11,800
-45,000	5,474,800	+6,800

<5月8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(-1Y)	23/ 5/ 9	1,500億 応札 4,653億 落札 1,500億	平均 +0.006%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	23/ 5/ 9	4,250億 応札 11,195億 落札 4,257億	最低 0.000% 平均 +0.001% 按分 47.7%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 5/ 9	5,000億 応札 13,505億 落札 5,006億	最低 -0.001% 平均 +0.001% 按分 83.4%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 5/ 9	2,000億 応札 3,943億 落札 2,006億	最低 +0.001% 平均 +0.004% 按分 18.8%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 5/ 9	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.085%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 5/ 9	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.270%
(11:50) 国債補充供給	23/ 5/ 8-23/ 5/ 9	応札 41,106億 落札 41,106億	全取 -0.450% 平均 -0.450%
(13:50) 国債補充供給	23/ 5/ 8-23/ 5/ 9	応札 0億 落札 0億	

<5月8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)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	
102,116	0	成長基盤強化支援資金供給	1,716	
		貸出増加支援資金供給		
1/ 5~ 1/ 6 10,016. (5/ 9(-1Y) 1,500.)	52,200	722,786	5/14~ 5/12 300.	
1/ 6~ 1/ 6 20,014. (5/ 9(1-3Y) 4,257.)	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.	6/11~ 5/12 596.	
1/10~ 1/10 20,011. (5/ 9(3-5Y) 5,006.)	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.	8/20~ 8/18 0.	
1/13~ 1/14 20,008. (5/ 9(10-25Y) 2,006.)	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.	11/19~11/17 0.	
1/16~ 1/16 20,009.	9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.	
1/19~ 1/20 1,163.	12/ 4~12/ 4 10,258.		5/17~ 5/17 0.	
4/19~ 5/10 10,895.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.		8/19~ 8/19 381.	
	6/ 3~ 6/ 3 1,950.		11/18~11/18 93.	
	9/ 2~ 9/ 2 1,804.		2/17~ 2/17 346.	
		※直近約1年分の期落ち分を記載		
		米ドル資金供給オペ		
		0百万ドル		
		4/25~ 5/11 0.		
		4/26~ 5/11 0.		
		成長基盤強化支援米ドル特別		
		4/27~ 5/11 0.		
		17,709百万ドル		
		4/28~ 5/11 0.		
		6/ 3~ 6/ 2 5,848.		
		5/ 1~ 5/11 0.		
		9/ 2~ 9/ 5 6,101.		
		5/ 2~ 5/11 0.		
		12/ 2~12/ 4 3,607.		
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.		
		国債買現先オペ		
		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		
		国庫短期証券買入額(月初来)		
		0		
		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(月初来)		
		0		
		CP買入額(月初来)		
		0		
		社債買入額(月初来)		
		0		
		社債買入額(月初来)		
		0		
		貸出増加支援		
		650,943	手形売出 0	
		新型コロナウイルス企業金融支援		
		57,296	国債売現先 0	
		供給オペ合計	904,256	国債補充供給 41,106
		貸出(推定)	0	国債売現先 0
		供給額合計	904,256	吸収額合計 41,106
		差引き	863,150	
		気候変動対応支援資金供給		
		44,214		
		7/21~ 7/21 15,953.		
		1/30~ 1/30 28,261.		

<5月8日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	102,116	CP等買入(推定)	22,800
国債買現先	0	社債等買入(推定)	79,300
被災地金融機関支援	1,716		
気候変動対応支援	44,214		
成長基盤強化支援	47,971		
貸出増加支援	650,943	手形売出	0
新型コロナウイルス企業金融支援	57,296	国債売現先	0
供給オペ合計	904,256	国債補充供給	41,106
貸出(推定)	0	国債売現先	0
供給額合計	904,256	吸収額合計	41,106

※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8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	0.000	1M	-----	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	+0.040000	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

<5月2日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	188,661	-103
有担保	21,800	-1,100
無担保	166,861	+997

<5月8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	-0.085	0.001	-0.073	+0.001	-----	-----	-----	-----	-0.097	+0.127
トムネ				-----					-0.103	+0.050
スポネ				-----						
1週間物	-0.070	-0.025	-0.055	-0.015					-0.123	+0.039
2週間物	-0.075	0.001	-0.051	-0.002					-0.132	+0.032
3週間物			-0.010	-----					-0.141	+0.027
1ヶ月物	-0.035	-0.020	-0.028	-0.046					-0.150	+0.020
3ヶ月物			0.004	±0					-0.157	+0.007
6ヶ月物				-----					-0.129	+0.002
1年物				-----					-0.102	±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