

東京短資デイリーレポート

2023/5/12

<5月11日のマネタリーベース>

6,720,100

<5月12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	5,465,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,452,700
日銀当座預金残高増減前日比	+12,600

<5月12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	+1,700
財政等要因	-19,600
資金過不足	-17,900
金融調節	
国庫短期証券買入	期落 新規
CP等買入	-100
被災地金融機関支援	-900 +200
国債補完供給	+28,700
金融調節合計	+4,500
当座預金増減-②	-13,400

<5月12日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,439,300
準備預金残高	4,770,900
積み終了先	4,770,800
超過準備	4,770,800
非準備先残高	668,400

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,872,100
今積み期間所要準備額 (平均)	129,100
残り要積立額 (積数)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率 (%)	100.0
日数進捗率 (%)	96.7
進捗率乖離幅	+3.3

<5月15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	+1,500
財政等要因	-2,500
資金過不足	-1,000
金融調節確定分	
国債買入	期落 新規
CP等買入	-400
国債補完供給	+24,400
金融調節合計	+37,700
当座預金増減	+36,700

<5月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆6,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.040%~-0.020% での合いが中心か。

<5月15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	5,521,000	+81,700
+40,000	5,516,000	+76,700
+35,000	5,511,000	+71,700
+30,000	5,506,000	+66,700
+25,000	5,501,000	+61,700
+20,000	5,496,000	+56,700
+15,000	5,491,000	+51,700
+10,000	5,486,000	+46,700
+5,000	5,481,000	+41,700
±0	5,476,000	+36,700
-5,000	5,471,000	+31,700
-10,000	5,466,000	+26,700
-15,000	5,461,000	+21,700
-20,000	5,456,000	+16,700
-25,000	5,451,000	+11,700
-30,000	5,446,000	+6,700
-35,000	5,441,000	+1,700
-40,000	5,436,000	-3,300
-45,000	5,431,000	-8,300

<5月12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-3Y)	23/ 5/15	4,250億 応札 7,183億 落札 4,251億 最低 -0.008% 平均 -0.004% 按分 58.1%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 5/15	6,250億 応札 13,550億 落札 6,265億 最低 -0.014% 平均 -0.012% 按分 62.8%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 5/15	2,000億 応札 4,138億 落札 2,005億 最低 -0.009% 平均 -0.007% 按分 85.7%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/ 5/15	1,000億 応札 3,444億 落札 1,002億 最低 -0.003% 平均 -0.002% 按分 64.9%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 5/15	応札 0億 落札 0億 固定利回較差 +0.115%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 5/15	応札 0億 落札 0億 固定利回較差 +0.305%
(11:50) 国債補完供給	23/ 5/12-23/ 5/15	応札 24,396億 落札 24,396億 全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 5/12-23/ 5/15	応札 0億 落札 0億

<5月12日 各オペア残高と内訳>

(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
99,166	12,769	成長基盤強化支援資金供給	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
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	5/ 9(1-3Y) 4,257.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.
1/10~ 1/10 20,011.	5/ 9(3-5Y) 5,006.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.
1/13~ 1/14 20,008.	5/ 9(10-25Y) 2,006.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.
1/16~ 1/16 20,009.	(5/15(1-3Y) 4,251.)	9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.
1/19~ 1/20 1,163.	(5/15(5-10Y) 6,265.)	12/ 4~12/ 4 10,258.	8/19~ 8/19 381.
5/10~ 5/24 7,945.	(5/15(10-25Y) 2,005.)	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	11/18~11/18 93.
	(5/15(25Y-) 1,002.)	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	2/17~ 2/17 346.
		9/ 2~ 9/ 2 1,804.	5/12~ 5/12 181.
		※直近約1年分の期落ち分を記載	※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	米ドル資金供給オペ
		17,709百万ドル	0百万ドル
		6/ 3~ 6/ 2 5,848.	5/11~ 5/18 0.
		9/ 2~ 9/ 5 6,101.	
		12/ 2~12/ 4 3,607.	
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
		国債買入先オペ	
		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)	
		1,001	
		5/12 1,001.	
		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	
		CP買入額(月初来)	
		0	
		(5/16 3,995.)	
		社債買入額(月初来)	
		0	
		社債等買入(推定)	
		22,300	
		国債買入先	
		0	
		被災地金融機関支援	
		1,001	
		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	
		900,591	
		国債補完供給	
		24,396	
		貸出(推定)	
		0	
		国債売現先	
		0	
		供給額合計	
		900,591	
		吸収額合計	
		24,396	
		差し引き	
		876,195	

※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12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 -----	1Y 買気配 -0.030
1M 売気配 -0.020		

<5月11日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	186,666	-2,831
有担保	26,597	-352
無担保	160,069	-2,479

<5月12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	-0.060	0.001	-0.030	+0.016				-----	-0.091	+0.006
トムネ				-----				-----	-0.095	+0.005
スポネ				-----				-----		
1週間物			-0.035	+0.003				-----	-0.123	+0.001
2週間物	-0.034	-0.018	-0.026	-0.009				-----	-0.135	+0.001
3週間物				-----				-----	-0.142	±0
1ヶ月物			-0.013	-0.113				-----	-0.149	+0.001
3ヶ月物				-----				-----	-0.157	-0.003
6ヶ月物				-----				-----	-0.129	±0
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