

東京短資デイリーレポート

2023/5/25

<5月24日のマナタリーベース>

6,686,100

<5月25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	5,487,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,426,100
日銀当座預金残高増減前日比	+61,400

<5月25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	-200	
財政等要因	+15,400	
資金過不足	+15,200	
金融調節		
国債買入	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入	-900	
国債補完供給	+29,800	-29,100
金融調節合計		+16,800
当座預金増減-②		+32,000

<5月25日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,458,100
準備預金残高	4,755,400
積み終了先	4,753,500
超過準備	4,753,500
非準備先残高	702,700

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,008,700
今積み期間所要準備額(平均)	129,300
残り要積立額(積数)	12,300
残り要積立額(平均)	600
準備進捗率(%)	99.6
日数進捗率(%)	32.3
進捗率乖離幅	+67.3

<5月26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	-100	
財政等要因	+12,000	
資金過不足	+11,900	
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
新型コロナ対応金融	-5,400	
国債補完供給	+29,100	
金融調節合計		+23,500
当座預金増減		+35,400

<5月26日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残549兆3,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.065%~-0.055% での合いが中心か。

<5月26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	5,538,500	+80,400
+40,000	5,533,500	+75,400
+35,000	5,528,500	+70,400
+30,000	5,523,500	+65,400
+25,000	5,518,500	+60,400
+20,000	5,513,500	+55,400
+15,000	5,508,500	+50,400
+10,000	5,503,500	+45,400
+5,000	5,498,500	+40,400
±0	5,493,500	+35,400
-5,000	5,488,500	+30,400
-10,000	5,483,500	+25,400
-15,000	5,478,500	+20,400
-20,000	5,473,500	+15,400
-25,000	5,468,500	+10,400
-30,000	5,463,500	+5,400
-35,000	5,458,500	+400
-40,000	5,453,500	-4,600
-45,000	5,448,500	-9,600

<5月25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(国)(5Y-10Y)	23/ 5/26	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.095%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 5/26	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.280%
(11:50) 国債補完供給	23/ 5/25-23/ 5/26	応札	29,056億	落札	29,056億	全取	-0.450% 平均 -0.451%
(13:50) 国債補完供給	23/ 5/25-23/ 5/26	応札	0億	落札	0億		

<5月25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
98,936	59,332	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.	5/19(1-3Y) 4,251.	52,200	722,786
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	5/19(3-5Y) 5,007.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.
1/10~ 1/10 20,011.	5/19(5-10Y) 5,757.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.
1/13~ 1/14 20,008.	5/19(25Y-) 1,002.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.
1/16~ 1/16 20,009.	5/25(1-3Y) 4,252.	9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.
1/19~ 1/20 1,163.	5/25(3-5Y) 5,006.	12/ 4~12/ 4 10,258.	8/19~ 8/19 381.
5/24~ 6/ 7 7,715.	5/25(5-10Y) 5,756.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	11/18~11/18 93.
	5/25(10-25Y) 2,009.	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
			米ドル資金供給オペ
			0百万ドル
			5/25~ 6/ 1 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
			17,709百万ドル
			6/ 3~ 6/ 2 5,848.
			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
			※直近約1週間の実施分を記載
			国庫短期証券買入額(月初来)
			3,005
			5/12 1,001.
			5/17 1,001.
			5/24 1,003.
			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)
			3,995
			5/16 3,995.
			社債買入額(月初来)
			1,000
			5/23 1,000.
			貸出増加支援
			650,943
			手形売出
			0
			新型コロナ企業金融支援
			57,296
			国債売現先
			0
			供給オペ合計
			900,361
			国債補完供給
			29,056
			貸出(推定)
			0
			国売現(米ドル担保)
			0
			供給額合計
			900,361
			吸収額合計
			29,056
			差し引き
			871,305

※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25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 +0.008000	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24日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	192,173	+942
有担保	25,858	-1,020
無担保	166,315	+1,962

<5月25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	-0.087	0.001	-0.059	-0.012					-0.173	-0.020
トムネ									-0.257	-0.047
スポネ										
1週間物	-0.058	-0.003	-0.038	+0.002					-0.238	-0.051
2週間物	-0.070	0.040	-0.042	+0.008					-0.201	-0.023
3週間物									-0.187	-0.015
1ヶ月物									-0.186	-0.020
3ヶ月物			0.011	-0.009					-0.168	-0.005
6ヶ月物									-0.136	-0.001
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