

東京短資デイリーレポート

2024/3/28

<3月27日のマネタリーベース>

6,837,400

<3月28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	5,625,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,580,600
日銀当座預金残高増減前日比	+44,700

<3月28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		-100
財政等要因		+2,600
資金過不足		+2,500
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-300	
国債補完供給	+36,200	-36,600
金融調節合計		-700
当座預金増減-②		+1,800

<3月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,582,400
準備預金残高	4,918,500
積み終了先	4,918,200
超過準備	4,916,600
非準備先残高	663,900

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,047,500
今積み期間所要準備額(平均)	130,600
残り要積立額(積数)	1,000
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+58.0

<3月29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		+800
財政等要因		+28,700
資金過不足		+29,500
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+11,300
CP等買入	-7,700	+4,000
国債補完供給	+36,600	
金融調節合計		+44,200
当座預金増減		+73,700

<3月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残565兆6,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.070%~+0.080% での出合いが中心か。
--

<3月29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	5,701,100	+118,700
+40,000	5,696,100	+113,700
+35,000	5,691,100	+108,700
+30,000	5,686,100	+103,700
+25,000	5,681,100	+98,700
+20,000	5,676,100	+93,700
+15,000	5,671,100	+88,700
+10,000	5,666,100	+83,700
+5,000	5,661,100	+78,700
±0	5,656,100	+73,700
-5,000	5,651,100	+68,700
-10,000	5,646,100	+63,700
-15,000	5,641,100	+58,700
-20,000	5,636,100	+53,700
-25,000	5,631,100	+48,700
-30,000	5,626,100	+43,700
-35,000	5,621,100	+38,700
-40,000	5,616,100	+33,700
-45,000	5,611,100	+28,700

<3月28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)	24/ 3/29	4,250億	応札 6,070億	落札 4,252億	最低 -0.013%	平均 -0.008%	按分 58.7%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 3/29	4,750億	応札 7,070億	落札 4,754億	最低 -0.008%	平均 -0.006%	按分 82.4%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 3/29	1,500億	応札 3,800億	落札 1,505億	最低 -0.012%	平均 -0.008%	按分 18.9%
(10:10) 国債買入(物国)	24/ 3/29	600億	応札 2,306億	落札 600億	按分 -0.310円	平均 -0.335円	
(11:50) 国債補完供給	24/ 3/28-24/ 3/29		応札 37,102億	落札 37,102億	全取 -0.250%	平均 -0.250%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 3/28-24/ 3/29		応札 1億	落札 1億	全取 -0.250%	平均 -0.250%	

<3月28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
114,690	48,055	成長基盤強化支援資金供給	1,001
3/19~ 4/ 3 23,469.	3/25(1-3Y) 3,752.	33,473	864,191
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	3/25(3-5Y) 4,255.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/ 5~ 1/ 6 20,016.	3/25(5-10Y) 4,756.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/10~ 1/10 20,011.	3/25(10-25Y) 1,503.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/13~ 1/14 20,008.	(3/29(3-5Y) 4,252.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/16~ 1/16 20,009.	(3/29(5-10Y) 4,754.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	
1/19~ 1/20 1,163.	(3/29(10-25Y) 1,505.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	
	(3/29(物国) 600.)	12/ 1~12/ 1 2,464.	
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	
			※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
			3/28~ 4/ 4 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
			16,370百万ドル
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.
			12/ 4~12/ 4 3,325.
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			0
			国庫短期証券買入額(月初来)
			国債売現先オペ
			2,003
			0
			3/ 6 1,002.
			3/13 1,001.
			CP買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			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
			国債補完供給
			37,103
			3/28~ 3/29 37,102.
			3/28~ 3/29 1.
			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
			国債買入額(月初来)
			3,995
			3/12 3,995.
			(3/29 3,996.)
			社債買入額(月初来)
			1,000
			3/21 1,000.
			ETF買入額
			356,921
			約定 23/10/ 4 701.
			ETF