

# 東京短資デイリーレポート

2024/5/29

## <5月28日のマネタリーベース>

6,777,000
-----------

## <5月29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	5,554,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,533,800
日銀当座預金残高増減前日比	+21,100

## <5月29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	+300		
財政等要因	-10,700		
資金過不足	-10,400		
金融調節			
共通担保(全店)	-7,000	期落	新規
CP等買入	-500		
国債補完供給	+28,700		-28,500
金融調節合計			-100
当座預金増減-②			-10,500

## <5月29日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,523,300
準備預金残高	4,877,900
積み終了先	4,877,000
超過準備	4,877,000
非準備先残高	645,400

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,079,800
今積み期間所要準備額(平均)	131,600
残り要積立額(積数)	6,000
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	45.2
進捗率乖離幅	+54.6

## <5月30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	+600		
財政等要因	+700		
資金過不足	+1,300		
金融調節確定分			
国債補完供給	+28,500	期落	新規
金融調節合計			+28,500
当座預金増減			+29,800

## <5月30日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残555兆3,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。
---

## <5月30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	5,598,100	+74,800
+40,000	5,593,100	+69,800
+35,000	5,588,100	+64,800
+30,000	5,583,100	+59,800
+25,000	5,578,100	+54,800
+20,000	5,573,100	+49,800
+15,000	5,568,100	+44,800
+10,000	5,563,100	+39,800
+5,000	5,558,100	+34,800
±0	5,553,100	+29,800
-5,000	5,548,100	+24,800
-10,000	5,543,100	+19,800
-15,000	5,538,100	+14,800
-20,000	5,533,100	+9,800
-25,000	5,528,100	+4,800
-30,000	5,523,100	-200
-35,000	5,518,100	-5,200
-40,000	5,513,100	-10,200
-45,000	5,508,100	-15,200

## <5月29日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 5/29-24/ 5/30	応札 29,270億 落札 29,270億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 5/29-24/ 5/30	応札 0億 落札 0億
( 9:30) 成長基盤(米ドル特則)	24/ 6/ 3-25/ 6/ 3	2,483m1 先数 14先
( 9:30) 成長基盤(米ドル特則)	24/ 6/ 3-25/ 6/ 3	2,835m1 先数 15先

## <5月29日 各オペ残高と内訳>

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
9,8380	45,625	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
5/29~ 6/12 7,159.	5/24(1-3Y) 3,564.	33,473	864,191
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	5/24(3-5Y) 4,255.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	5/24(5-10Y) 4,255.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/10~ 1/10 20,011.		12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.
1/13~ 1/14 20,008.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/16~ 1/16 20,009.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.
1/19~ 1/20 1,163.		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
			5/23~ 5/30 0.
			(5/30~ 6/ 6 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則
			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.
			(6/ 3~ 6/ 3 5,318.)
			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)
			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
			CP買入額(月初来)
			2,995
			5/17 2,995.
			(5/31 2,995.)
			社債買入額(月初来)
			750
			5/24 750.
			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

※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29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 +0.070	1M +0.198000	3M 買気配 +0.050
1W 売気配 +0.070	2M +0.150000	6M 買気配 +0.150
2W 売気配 +0.070	3M +0.230000	1Y 買気配 +0.250
1M 売気配 +0.070		

## <5月28日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	113,656	-1,047
有担保	38,852	-144
無担保	74,804	-903

## <5月29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	0.070	0.145	0.078	+0.001					0.047	+0.002
トムネ									0.051	+0.010
スポネ										
1週間物			0.118						0.057	+0.002
2週間物									0.058	+0.001
3週間物									0.058	±0
1ヶ月物			0.200	+0.040					0.058	+0.001
3ヶ月物			0.200	±0					0.083	+0.001
6ヶ月物									0.117	+0.007
1年物									0.195	+0.002

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