

東京短資デイリーレポート

2024/5/31

<5月30日のマネタリーベース>

6,763,500

<5月31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	5,547,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,521,200
日銀当座預金残高増減前日比	+26,200

<5月31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		+400
財政等要因		-9,500
資金過不足		-9,100
金融調節		
CP等買入	-2,300	+3,000
国債補充供給	+30,300	-27,800
金融調節合計		+3,200
当座預金増減-②		-5,900

<5月31日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,515,300
準備預金残高	4,848,000
積み終了先	4,847,400
超過準備	4,847,400
非準備先残高	667,300

<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)	3,300
残り要積立額(平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	58.1
進捗率乖離幅	+41.8

<6月3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		+900
財政等要因		-64,600
資金過不足		-63,700
金融調節確定分		
国債買入		+10,900
社債等買入	-100	
国債補充供給	+27,800	
成長基盤強化支援	-1,600	
金融調節合計		+37,000
当座預金増減		-26,700

<6月3日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残548兆8,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<6月3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	5,533,600	+18,300
+40,000	5,528,600	+13,300
+35,000	5,523,600	+8,300
+30,000	5,518,600	+3,300
+25,000	5,513,600	-1,700
+20,000	5,508,600	-6,700
+15,000	5,503,600	-11,700
+10,000	5,498,600	-16,700
+5,000	5,493,600	-21,700
±0	5,488,600	-26,700
-5,000	5,483,600	-31,700
-10,000	5,478,600	-36,700
-15,000	5,473,600	-41,700
-20,000	5,468,600	-46,700
-25,000	5,463,600	-51,700
-30,000	5,458,600	-56,700
-35,000	5,453,600	-61,700
-40,000	5,448,600	-66,700
-45,000	5,443,600	-71,700

<5月31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/ 6/ 3	4,250億 応札 9,930億 落札 4,256億 最低 0.000% 平均 0.000% 按分 98.7%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 6/ 3	4,250億 応札 9,879億 落札 4,257億 最低 +0.003% 平均 +0.007% 按分 32.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 6/ 3	1,500億 応札 3,751億 落札 1,504億 最低 +0.021% 平均 +0.022% 按分 32.9%
(10:10) 国債買入(25Y-)	24/ 6/ 3	750億 応札 2,303億 落札 754億 最低 +0.030% 平均 +0.031% 按分 5.2%
(10:10) 国債買入(物国)	24/ 6/ 3	600億 応札 2,671億 落札 601億 按分 -0.070円 平均 -0.192円 按分 6.0%
(11:50) 国債補充供給	24/ 5/31-24/ 6/ 3	応札 28,611億 落札 28,611億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補充供給	24/ 5/31-24/ 6/ 3	応札 0億 落札 0億

<5月31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(月初末)	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 8,3 8 0	4 5,6 2 5	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.	3 3,4 7 3	8 6 4,1 9 1	8/19~ 8/19 381.						
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	5/24(3-5Y) 4,255.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.						
1/ 5~ 1/ 6 20,016.	5/24(5-10Y) 4,255.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.						
1/10~ 1/10 20,011.	(6/ 3(3-5Y) 4,256.)	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	5/17~ 5/12 0.						
1/13~ 1/14 20,008.	(6/ 3(5-10Y) 4,257.)	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.						
1/16~ 1/16 20,009.	(6/ 3(10-25Y) 1,504.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.						
1/19~ 1/20 1,163.	(6/ 3(25Y-) 754.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.						
	(6/ 3(物国) 601.)	12/ 1~12/ 1 2,464.		2/16~ 2/16 0.						
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.								
			※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							
			1 6,3 7 0 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						
				国債短期証券買入額(月初末)						
				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)(月初末)						
				0						
				国債補充供給						
				2 8,6 1 1						
				5/31~ 6/ 3 28,611.						
				5/31~ 6/ 3 0.						
				ETF買入額						
				3 5 6,9 2 1						
				約定 23/10/ 4 701.						
				ETF買入額(企業支援)						
				1 4,6 2 8						
				約定 21/ 3/31 12.						
				J-REIT買入額						
				6,8 2 3						
				約定 22/ 6/14 12.						
				※直近約1週間の実施分を記載						
				CP買入額(月初末)						
				5,9 9 0						
				5/17 2,995.						
				5/31 2,995.						
				社債買入額(月初末)						
				7 5 0						
				5/24 750.						
				※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31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 -----	3M 買気配 +0.050				
				1W 売気配 +0.070	2M -----	6M 買気配 +0.150				
				2W 売気配 +0.070	3M -----	1Y 買気配 +0.250				
				1M 売気配 +0.070						
							<5月30日のコール市場残高(単位:億円)>			
							残高 増減			
							市場合計 115,755 -800			
							有担保 39,471 -335			
							無担保 76,284 -465			
							<5月31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	
							0.060 0.079 0.077 ±0			0.018 -0.021
							翌日物			0.071 +0.038
							トムネ			
							スポネ			
							1週間物			0.056 +0.001
							2週間物			0.058 ±0
							3週間物			0.057 -0.001
							1ヶ月物			0.057 ±0
							3ヶ月物			0.085 +0.002
							6ヶ月物			0.127 +0.005
							1年物			0.200 +0.001

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