

東京短資デイリーレポート

2025/5/29

<5月28日のマネタリーベース>

6,552,100

<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	5,323,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,331,700
日銀当座預金残高増減前日比	-8,200

<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		+200
財政等要因		-11,000
資金過不足		-10,800
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+1,000	-1,600
金融調節合計		-600
当座預金増減-②		-11,400

<5月29日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,320,300
準備預金残高	4,829,600
積み終了先	4,829,000
超過準備	4,828,900
非準備先残高	490,700

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,107,900
今積み期間所要準備額 (平均)	132,500
残り要積立額 (積数)	5,000
残り要積立額 (平均)	300
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		+700
財政等要因		-6,200
資金過不足		-5,500
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+7,400
社債等買入		-100
国債補完供給	+1,600	
金融調節合計		+8,900
当座預金増減		+3,400

<5月30日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残532兆3,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での出合いが中心か。
--

<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	5,368,700	+48,400
+40,000	5,363,700	+43,400
+35,000	5,358,700	+38,400
+30,000	5,353,700	+33,400
+25,000	5,348,700	+28,400
+20,000	5,343,700	+23,400
+15,000	5,338,700	+18,400
+10,000	5,333,700	+13,400
+5,000	5,328,700	+8,400
± 0	5,323,700	+3,400
-5,000	5,318,700	-1,600
-10,000	5,313,700	-6,600
-15,000	5,308,700	-11,600
-20,000	5,303,700	-16,600
-25,000	5,298,700	-21,600
-30,000	5,293,700	-26,600
-35,000	5,288,700	-31,600
-40,000	5,283,700	-36,600
-45,000	5,278,700	-41,600

<5月29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)	25/ 5/30	2,750億	応札	6,428億	落札	2,753億	最低	-0.009%	平均	-0.007%	按分	55.4%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 5/30	3,000億	応札	7,460億	落札	3,003億	最低	-0.013%	平均	-0.009%	按分	5.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 5/30	1,350億	応札	3,705億	落札	1,353億	最低	+0.004%	平均	+0.004%	按分	72.9%
(10:10) 国債買入(物国)	25/ 5/30	500億	応札	1,999億	落札	500億	按分	-0.380円	平均	-0.520円	按分	1.0%
(11:50) 国債補完供給	25/ 5/29-25/ 5/30		応札	1,697億	落札	1,697億	全取	+0.250%	平均	+0.250%		
(13:50) 国債補完供給	25/ 5/29-25/ 5/30		応札	0億	落札	0億						

<5月29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
8,005	33,486	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
5/28~ 6/11 8,005.	5/26(1-3Y) 2,752. 5/26(3-5Y) 2,752. 5/26(5-10Y) 3,005. 5/26(10-25Y) 1,351. (5/30(3-5Y) 2,753.) (5/30(5-10Y) 3,003.) (5/30(10-25Y) 1,353.) (5/30(物国) 500.)	21,214 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 3/ 4~ 3/ 4 830.	791,136 6/18~ 6/18 26,498. 6/19~ 6/18 67,646. 9/15~ 9/12 27,659. 9/13~ 9/12 121,454. 12/15~12/15 20,129. 12/13~12/15 33,838. 3/16~ 3/16 38,879. 3/17~ 3/16 18,695.
共通担保(全店)金利入札	70,035	※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	※直近約1年分の期落ち分を記載 米ドル資金供給オペ
1/24~ 1/24 10,003. 2/ 1~ 2/ 1 10,004. 2/15~ 2/15 10,004. 3/ 1~ 3/ 1 10,010. 9/15~ 9/15 10,005. 10/10~10/10 10,006. 10/25~10/25 10,003.	0	8,651百万ドル 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830. (6/ 3~ 6/ 3 2,384.) 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 C P買入額(月初来) 0 社債買入額(月初来) 0	0百万ドル 5/29~ 6/ 5 0. 気候変動対応支援資金供給 142,065 成長基盤支援 17,307 手形売出 0 貸出増加支援 730,190 国債売現先 0 供給オペ合計 967,938 国債補完供給 1,697 貸出(推定) 0 国売現(米ドル担保) 0 供給額合計 967,938 吸収額合計 1,697 差し引き 966,241
国債補完供給	1,697		
5/29~ 5/30 1,697. 5/29~ 5/30 0.	0		
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.			

※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 売気配 +0.400	1M +0.540000	3M 買気配 +0.400
1W 売気配 +0.400	2M +0.580000	6M 買気配 +0.500
2W 売気配 +0.400	3M +0.610000	1Y 買気配 +0.650
1M 売気配 +0.400		

<5月28日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	112,806	-3,619
有担保	31,205	-282
無担保	81,601	-3,337

<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	0.450	0.478	0.476	± 0			0.430	± 0	0.488	-0.007
トムネ				-----				-----	0.467	-0.021
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.473	-0.003
2週間物			0.530	+0.052				-----	0.473	-0.001
3週間物				-----				-----	0.471	-0.001
1ヶ月物			0.560	-----				-----	0.472	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.481	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.500	+0.001
1年物				-----				-----	0.572	± 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