

# 東京短資デイリーレポート

2023/5/15

## <5月12日のマネタリーベース>

6,705,100
-----------

## <5月15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	5,476,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,439,300
日銀当座預金残高増減前日比	+36,700

## <5月15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		+1,500
財政等要因		+700
資金過不足		+2,200
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+13,700
CP等買入	-400	
国債補完供給	+24,400	-28,600
金融調節合計		+9,100
当座預金増減-②		+11,300

## <5月15日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,450,600
準備預金残高	4,833,900
積み終了先	4,833,900
超過準備	4,833,900
非準備先残高	616,700

## <参考>

翌積み期間所要準備額 (積数)	4,008,700
翌積み期間所要準備額 (平均)	129,300

## <5月16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		+1,500
財政等要因		-25,600
資金過不足		-24,100
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	+4,000
国債補完供給	+28,600	
金融調節合計		+32,400
当座預金増減		+8,300

## <5月16日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残545兆8,900億円)で 無担保コール0/Nは-0.050%~-0.020% での合いが中心か。
---

## <5月16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	5,503,900	+53,300
+40,000	5,498,900	+48,300
+35,000	5,493,900	+43,300
+30,000	5,488,900	+38,300
+25,000	5,483,900	+33,300
+20,000	5,478,900	+28,300
+15,000	5,473,900	+23,300
+10,000	5,468,900	+18,300
+5,000	5,463,900	+13,300
± 0	5,458,900	+8,300
-5,000	5,453,900	+3,300
-10,000	5,448,900	-1,700
-15,000	5,443,900	-6,700
-20,000	5,438,900	-11,700
-25,000	5,433,900	-16,700
-30,000	5,428,900	-21,700
-35,000	5,423,900	-26,700
-40,000	5,418,900	-31,700
-45,000	5,413,900	-36,700

## <5月15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/ 5/16	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.120%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 5/16	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.315%
(11:50) 国債補完供給	23/ 5/15-23/ 5/16	応札	28,587億	落札	28,587億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 5/15-23/ 5/16	応札	0億	落札	0億		

## <5月15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
99,166	26,292	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/ 9(-1Y) 1,500.	52,200	722,786
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	5/ 9(1-3Y) 4,257.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.
1/10~ 1/10 20,011.	5/ 9(3-5Y) 5,006.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.
1/13~ 1/14 20,008.	5/ 9(10-25Y) 2,006.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.
1/16~ 1/16 20,009.	5/15(1-3Y) 4,251.	9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.
1/19~ 1/20 1,163.	5/15(5-10Y) 6,265.	12/ 4~12/ 4 10,258.	8/19~ 8/19 381.
5/10~ 5/24 7,945.	5/15(10-25Y) 2,005.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	11/18~11/18 93.
	5/15(25Y-) 1,002.	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
			5/11~ 5/18 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.
			国債買現先オペ
			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)(月初末)
			0
			国庫短期証券買入額(月初末)
			1,001
			5/12 1,001.
			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
			C P買入額(月初末)
			0
			( 5/16 3,995.)
			社債買入額(月初末)
			0
			貸出増加支援
			650,943
			手形売出
			0
			貸出増加支援
			57,296
			国債売現先
			0
			供給オペ合計
			900,591
			国債補完供給
			28,587
			貸出(推定)
			0
			国債売現先
			0
			供給額合計
			900,591
			吸収額合計
			28,587
			差し引き
			872,004
			気候変動対応支援資金供給
			44,214
			7/21~ 7/21 15,953.
			1/30~ 1/30 28,261.

## <5月15日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,166	CP等買入(推定)	21,900
国債買現先	0	社債等買入(推定)	79,300
被災地金融機関支援	1,001		
気候変動対応支援	44,214		
成長基盤強化支援	47,971		
貸出増加支援	650,943	手形売出	0
貸出増加支援	57,296	国債売現先	0
供給オペ合計	900,591	国債補完供給	28,587
貸出(推定)	0	国債売現先	0
供給額合計	900,591	吸収額合計	28,587

※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15日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	NCD/CP買現先	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N	0.000	1M +0.010000	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12日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	182,638	-4,028
有担保	27,248	+651
無担保	155,390	-4,679

## <5月15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	-0.050	0.001	-0.023	+0.007				-----	-0.091	± 0
トムネ				-----				-----	-0.099	-0.004
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.050	-0.020	-0.045	-0.010				-----	-0.123	± 0
2週間物	-0.030	-0.003	-0.023	+0.003				-----	-0.132	+0.003
3週間物				-----				-----	-0.142	± 0
1ヶ月物	-0.050	0.000	-0.031	-0.018				-----	-0.150	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	-0.156	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	-0.130	-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