

<3月29日のマネタリーベース>

6,867,900

<4月1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	5,639,700	
前日の日銀当座預金残高-①	5,611,900	
日銀当座預金残高増減前日比	+27,800	

<4月1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	+700
財政等要因	-14,700
資金過不足	-14,000
金融調節	
国債補完供給	+42,600
金融調節合計	-1,800
当座預金増減-②	-15,800

<4月1日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,596,100
準備預金残高	4,910,300
積み終了先	4,910,300
超過準備	4,910,300
非準備先残高	685,800

<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)	200
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	54.8
進捗率乖離幅	+45.1

<4月2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	+100
財政等要因	-6,700
資金過不足	-6,600
金融調節確定分	
国債補完供給	+44,400
金融調節合計	+44,400
当座預金増減	+37,800

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.	

<4月2日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残563兆3,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%〜+0.080% での出会いが中心か。
--

<4月2日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,678,900	+82,800
+40,000	5,673,900	+77,800
+35,000	5,668,900	+72,800
+30,000	5,663,900	+67,800
+25,000	5,658,900	+62,800
+20,000	5,653,900	+57,800
+15,000	5,648,900	+52,800
+10,000	5,643,900	+47,800
+5,000	5,638,900	+42,800
± 0	5,633,900	+37,800
-5,000	5,628,900	+32,800
-10,000	5,623,900	+27,800
-15,000	5,618,900	+22,800
-20,000	5,613,900	+17,800
-25,000	5,608,900	+12,800
-30,000	5,603,900	+7,800
-35,000	5,598,900	+2,800
-40,000	5,593,900	-2,200
-45,000	5,588,900	-7,200

<4月1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。

(11:50) 国債補完供給	24/4/1-24/4/2	応札 44,903億 落札 44,903億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/4/1-24/4/2	応札 0億 落札 0億

<4月1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
114,690	0	成長基盤強化支援資金供給	1,001
		貸出増加支援資金供給	
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 10,016.	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.	5/12~5/12 181.
1/19~1/20 1,163.	3/29(10-25Y) 1,505.	9/1~9/1 5,024.	8/18~8/18 0.
	3/29(物国) 600.	12/1~12/1 2,464.	11/17~11/17 0.
		3/2~3/2 7,922.	2/16~2/16 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	米ドル資金供給オペ	気候変動対応支援資金供給
16,370百万ドル	0百万ドル	81,666
6/2~6/3 5,566.		
9/5~9/5 5,382.		
12/4~12/4 3,325.		
3/4~3/4 2,097.		

共通担保(全店)金利入札

70,035	
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.	

<4月1日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	114,690	CP等買入(推定)	22,200
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	60,900
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	1,001		
気候変動対応支援	81,666		
成長基盤支援	28,711	手形売出	0
貸出増加支援	782,979	国債売現先	0
供給オペ合計	1,079,082	国債補完供給	44,903
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	1,079,082	吸収額合計	44,903
		差し引き	1,034,179

※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。

<4月1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	0.000	1M	+0.200000	3M	買気配 -0.050
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 +0.100
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 +0.100
1M	売気配 -0.020				

<4月1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	最低	最高	平均	前日比	平均値	前日比
翌日物	0.055	0.078	0.077	+0.003			-----	0.013	+0.042
トムネ				-----			-----	0.010	± 0
スポネ				-----			-----		
1週間物			0.150	-----			-----	0.016	+0.003
2週間物	0.160	0.195	0.190	-----			-----	0.023	+0.005
3週間物				-----			-----	0.030	+0.002
1ヶ月物	0.135	0.200	0.171	-----			-----	0.038	+0.005
3ヶ月物	0.170	0.220	0.182	-----			-----	0.051	+0.002
6ヶ月物				-----			-----	0.074	± 0
1年物				-----			-----	0.103	± 0

<3月29日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	121,665	+1,755
有担保	27,244	-7,157
無担保	94,421	+8,912

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現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