

東京短資デイリーレポート

2024/4/30

<4月26日のマネタリーベース>

6,957,900

<4月30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	5,736,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,699,600
日銀当座預金残高増減前日比	+37,200

<4月30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		-900
財政等要因		+8,500
資金過不足		+7,600
金融調節		
CP等買入	-1,300	+4,000
国債補完供給	+32,400	-38,900
金融調節合計		-3,800
当座預金増減-②		+3,800

<4月30日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,703,400
準備預金残高	5,021,700
積み終了先	5,021,600
超過準備	5,021,600
非準備先残高	681,700

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,955,000
今積み期間所要準備額(平均)	131,800
残り要積立額(積数)	700
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	50.0
進捗率乖離幅	+49.9

<5月1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		-800
財政等要因		-75,600
資金過不足		-76,400
金融調節確定分		
共通担保(全店)	-7,000	+6,500
CP等買入	-700	
国債補完供給	+38,900	
金融調節合計		+37,700
当座預金増減		-38,700

<5月1日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残566兆4,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<5月1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	5,709,700	+6,300
+40,000	5,704,700	+1,300
+35,000	5,699,700	-3,700
+30,000	5,694,700	-8,700
+25,000	5,689,700	-13,700
+20,000	5,684,700	-18,700
+15,000	5,679,700	-23,700
+10,000	5,674,700	-28,700
+5,000	5,669,700	-33,700
±0	5,664,700	-38,700
-5,000	5,659,700	-43,700
-10,000	5,654,700	-48,700
-15,000	5,649,700	-53,700
-20,000	5,644,700	-58,700
-25,000	5,639,700	-63,700
-30,000	5,634,700	-68,700
-35,000	5,629,700	-73,700
-40,000	5,624,700	-78,700
-45,000	5,619,700	-83,700

<4月30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。

(10:40) 米ドル資金供給	24/ 5/ 2-24/ 5/ 9	応札 0m1 落札 0m1	貸付 5.580%
(11:50) 国債補完供給	24/ 4/30-24/ 5/ 1	応札 39,552億 落札 39,552億 全取 -0.250% 平均 -0.250%	
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 5/ 1-24/ 5/15	8,000億 応札 6,510億 落札 6,510億	貸付 0.100%
(13:50) 国債補完供給	24/ 4/30-24/ 5/ 1	応札 220億 落札 220億 全取 -0.250% 平均 -0.250%	

<4月30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)	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
9,824.1	59,189			1,001
4/17~ 5/ 1 7,020.	4/25(3-5Y) 4,256.	33,473	864,191	5/17~ 5/17 0.
(5/ 1~ 5/15 6,510.)	4/25(5-10Y) 4,755.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	4/25(10-25Y) 1,503.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	4/25(25Y-) 754.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	4/25(物国) 600.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.
1/13~ 1/14 20,008.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
1/16~ 1/16 20,009.		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
1/19~ 1/20 1,163.		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	
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			4/25~ 5/ 2 0.	
			(5/ 2~ 5/ 9 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	
			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.	
			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	
			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	
			CP買入額(月初来)	
			7,975	
			4/15 3,985.	
			4/30 3,990.	
			社債買入額(月初来)	
			1,001	
			4/22 1,001.	
			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	
			81,663	
			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	1,062,630
			国債補完供給	39,772
			貸出(推定)	0
			国売現(米ドル担保)	0
			供給額合計	1,062,630
			吸収額合計	39,772
			差し引き	1,022,858

※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30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 +0.100
2W	売気配 +0.070	3M	-----	1Y	買気配 +0.200
1M	売気配 +0.070				

<4月26日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,077	-540
有担保	35,711	-1,604
無担保	79,366	+1,064

<4月30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	0.078	0.076	-0.001				-----	0.001	-0.020
トムネ				-----				-----	0.008	-0.004
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.025	-0.002
2週間物			0.170	-0.002				-----	0.031	±0
3週間物				-----				-----	0.031	-0.002
1ヶ月物			0.180	+0.010				-----	0.033	±0
3ヶ月物	0.180	0.580	0.194	-----				-----	0.051	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.075	±0
1年物				-----				-----	0.113	+0.004

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