京短資デイリーレポート

2025/3/28

<3月27日のマネタリーベース> 6,512,200

<3月28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	高 5,299,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,276,900
日銀当座預金残高増減前日上	上 +22,600

<3月28日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

	, <u>, , </u>									
ئے ا	_ 資金需給実績									
	銀行券要因			+400						
ш	財政等要因			+19,800						
ш	資金過不足			+20,200						
1 🗀	金融調節									
		期	落	新規						
ш	CP等買入		-300							
ш	国債補完供給	+3	,600	-2,900						
	金融調節合計			+400						
	当座預金増減-②	座預金増減-② +20,600								

<3月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,297,500
準備預金残高	4,785,400
積み終了先	4,784,500
超過準備	4,783,900
非準預先残高	512,100

く参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,121,700
今積み期間所要準備額(平均)	133,000
残り要積立額(積数)	3,700
残り要積立額(平均)	200
準預進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	48.4
進捗率乖離幅	+51.5

<3月31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			+9,800					
資金過不足			+11,300					
金融調節確定分								
	期	落	新規					
国債買入			+8,000					
CP等買入	-2	,000						
│ │ │		-100						
国債補完供給	+2	,900						
金融調節合計			+8,800					
当座預金増減			+20,100					

2日21日のオペス相へ

<3月31日の4ヘア芯/
朝一の金融調節はノーオペ
(当預残531兆7,600億円)で
無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477%
での出合いが中心か。

3月31日9時20分	のオペによる日	銀当座預金状況
9時20分の	日銀当座	前日比
オペ	預金残高	増減
+45,000	5,362,600	+65,100
+40,000	5,357,600	+60,100
+35,000	5,352,600	+55,100
+30,000	5,347,600	+50,100
+25,000	5,342,600	+45,100
+20,000	5,337,600	+40,100
+15,000	5,332,600	+35,100
+10,000	5,327,600	+30,100
+5,000	5,322,600	+25,100
± 0	5,317,600	+20,100
-5,000	5,312,600	+15,100
-10,000	5,307,600	+10,100
-15,000	5,302,600	+5,100
-20,000	5,297,600	+100
-25,000	5,292,600	-4,900
-30,000	5,287,600	-9,900
-35,000	5,282,600	-14,900
-40,000	5,277,600	-19,900
-45,000	5,272,600	-24,900

AND HEALTH WATER			C 8 M	3 0 m a 1 a 1 a 2 a 3	。 pt//四/のナナイエIII で	こしず無くん	C C 0 %	
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	25/ 3/31	3,000億	応札	6,808億 落札	3,002億 最低	-0.017%	平均 -0.014% 按	分 79.4
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 3/31	3,250億	応札	6,912億 落札	3,252億 最低	-0.027%	平均 -0.022% 按	分 74.6%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 3/31	1,500億	応札	3,425億 落札	1,503億 最低	-0.014%	平均 -0.012% 按	分 86.7%
(10:10) 国債買入(物国)	25/ 3/31	500億	応札	1,602億 落札	500億 按分	+0.050円	平均-0.036円 按	分 68.0%
(11:50) 国債補完供給	25/ 3/28-25/ 3/31		応札	2,956億 落札	2,956億 全取	+0.150%	平均 +0.150%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 3/28-25/ 3/31		応札	0億 落札	0億			

<3月28日 各才ペ残高	5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)	
			して行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給
8.012	36,796	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	517
3/19~ 4/ 2 8,012.	3/25(1-3Y) 3,007.	21,214	791,136	5/12~ 5/12 181.
	3/25(3-5Y) 3,004.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		5/17~ 5/12 0.
	3/25(5-10Y) 3,256.	, , , ,		
	3/25(25Y-) 753.			
	, , ,	9/ 5~ 9/ 5 1,661.		
		12/ 1~12/ 1 2,464.		11/18~11/17 57.
			12/13~12/15 33,838.	2/16~ 2/16 0.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.		2/17~ 2/16 0.
	(, , , (, , , , , , , , , , , , , , ,	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.	, , ,
		, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	, = = = = = = = = = = = = = = = = = = =	
		※直近約1年分の期落ち分を記載	※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
		8.651百万ドル	0百万ドル	
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	3/27~ 4/ 3 0.	気候変動対応支援資金供給
共通担保(全店)金利入札		9/5~9/5 1,661.	3/21 1/ 3 0.	142,065
70,035		12/ 4~12/ 4 842.		7/19~ 7/18 72,361.
1/24~ 1/24 10,003.		3/ 4~ 3/ 4 830.		1/30~ 1/30 69,704.
2/ 1~ 2/ 1 10,004.		3/ + 3/ + 050.		1/30 1/30 03,104.
2/15~ 2/15 10,004.		国債買現先オペ		
3/ 1~ 3/ 1 10,010.		0	国債売現先(米ドルオペ用担保)	
9/15~ 9/15 10,005.			0	
10/10~10/10 10,006.				
10/25~10/25 10,003.				
10/23 10/23 10,003.			国庫短期証券買入額(月初来)	
		国債売現先オペ	0	
	※直近約1週間の実施分を記載	()	0	
	国債買入額(固定利回)(月初来)	U		
	0			
国債補完供給	0			
2,956				
3/28~ 3/31 2,956.		C P買入額(月初来)		
3/28~ 3/31 2,930.				
3/20 3/31 0.		0	<3月28日 日銀信用	血質/咬ノ胃切/へ
				(P等買入(推定) 12,300
				社債等買入(推定) 48.700
ETF買入額			国債買現先 0	
356,921			被災地金融機関支援 517	
約定 23/10/4 701.		社債買入額(月初来)	気候変動対応支援 142,065	
ETF買入額(企業支援)		(人)	成長基盤支援 17,307	
14,628		<u> </u>	貸出増加支援 730,190	
約定 21/ 3/31 12.	-		供給オペ合計 968.126	
	1			
J-REIT買入額 6,823			<u>貝西(推定) </u>	
	ツカング1 油田の中佐ハナラギ			
約定 22/ 6/14 12.	※直近約1週間の実施分を記載		差し引き	965,170

※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。

<3月28日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	120H0701 / /	اللاسدارا ا		4.70				
	NCD/CP現先	CI	Pプライマリ	TE	3アウトライト	<3月27日の	コール市場残高(単位:億円)
S/N	売気配 +0.400	1M	+0.590000	3M	買気配 +0.400		残高	増減
1W	売気配 +0.400	2M	+0.629000	6M	買気配 +0.450	市場合計	116,059	-2,058
2W	売気配 +0.400	3M	+0.665000	1Y	買気配 +0.650	有担保	34,499	-343
1 M	売気配 +0.400					無扣保	81.560	-1.715

<3月28日のコール巾場レート迷報と東京レホ・レート(早12:16)>												
		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	0.477	+0.001			0.430	± 0	0.481	+0.002		
トムネ									0.301	-0.146		
スポネ												
1週間物									0.425	-0.018		
2週間物									0.436	-0.009		
3週間物									0.442	-0.003		
1ヶ月物			0.560						0.441	-0.003		
3ヶ月物	0.605	0.625	0.613	-0.127					0.461	± 0		
6ヶ月物									0.504	+0.002		
1年物									0.604	± 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