

東京短資デイリーレポート

2025/5/14

<5月13日のマネタリーベース>

6,556,300

<5月14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	5,322,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,330,700
日銀当座預金残高増減前日比	-8,500

<5月14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		+1,300
財政等要因		-12,200
資金過不足		-10,900
金融調節		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+1,200	-2,100
金融調節合計		-900
当座預金増減-②		-11,800

<5月14日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,318,900
準備預金残高	4,823,500
積み終了先	4,823,500
超過準備	4,823,500
非準備先残高	495,400

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,983,000
今積み期間所要準備額 (平均)	132,800
残り要積立額 (積数)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	96.7
進捗率乖離幅	+3.3

<5月15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		+600
財政等要因		-4,000
資金過不足		-3,400
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+6,800
国債補完供給	+2,100	
金融調節合計		+8,900
当座預金増減		+5,500

<5月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残532兆4,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.478% での合いが中心か。

<5月15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	5,369,400	+50,500
+40,000	5,364,400	+45,500
+35,000	5,359,400	+40,500
+30,000	5,354,400	+35,500
+25,000	5,349,400	+30,500
+20,000	5,344,400	+25,500
+15,000	5,339,400	+20,500
+10,000	5,334,400	+15,500
+5,000	5,329,400	+10,500
± 0	5,324,400	+5,500
-5,000	5,319,400	+500
-10,000	5,314,400	-4,500
-15,000	5,309,400	-9,500
-20,000	5,304,400	-14,500
-25,000	5,299,400	-19,500
-30,000	5,294,400	-24,500
-35,000	5,289,400	-29,500
-40,000	5,284,400	-34,500
-45,000	5,279,400	-39,500

<5月14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(1Y-3Y)	25/ 5/15	2,750億	応札	8,426億	落札	2,753億	最低	+0.002%	平均	+0.003%	按分	19.8%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 5/15	3,000億	応札	9,246億	落札	3,001億	最低	-0.004%	平均	-0.004%	按分	87.8%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 5/15	1,350億	応札	3,377億	落札	1,354億	最低	+0.008%	平均	+0.013%	按分	68.6%
(11:50) 国債補完供給	25/ 5/14-25/ 5/15		応札	2,079億	落札	2,079億	全取	+0.250%	平均	+0.250%		
(13:50) 国債補完供給	25/ 5/14-25/ 5/15		応札	82億	落札	82億	全取	+0.250%	平均	+0.250%		

<5月14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	7,260	成長基盤強化支援資金供給	336
5/14~ 5/28 8,005.	5/ 8(-1Y) 1,002. 5/ 8(1-3Y) 2,753. 5/ 8(3-5Y) 2,752. 5/ 8(25Y-) 753. (5/15(1-3Y) 2,753.) (5/15(5-10Y) 3,001.) (5/15(10-25Y) 1,354.)	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.
※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	
成長基盤強化支援米ドル特則		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. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830.		5/ 9~ 5/15 0. (5/15~ 5/22 0.)	気候変動対応支援資金供給 142,065 7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 69,704.
国債買現先オペ		国債売現先(米ドルオペ用担保)	
0		0	
国債売現先オペ		国庫短期証券買入額(月初来)	
0		0	
C P買入額(月初来)		0	
0		0	
社債買入額(月初来)		0	
0		0	

<5月14日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	8,005	CP等買入(推定)	8,700
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	46,000
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	336		
気候変動対応支援	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	2,161
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	2,161
差し引き	965,777		

※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14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	+0.510000	3M	買気配 +0.450
1W	売気配 +0.400	2M	-----	6M	買気配 +0.450
2W	売気配 +0.400	3M	+0.620000	1Y	買気配 +0.600
1M	売気配 +0.400				

<5月14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	0.477	± 0			0.430	± 0	0.487	+0.010
トムネ				-----				-----	0.484	+0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.480	0.610	0.511	+0.015				-----	0.466	± 0
2週間物			0.478	-----				-----	0.464	± 0
3週間物				-----				-----	0.462	+0.002
1ヶ月物				-----				-----	0.461	+0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.468	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.494	+0.002
1年物				-----				-----	0.573	+0.002

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