

# 東京短資デイリーレポート

2024/1/12

## <1月11日のマナタリーベース>

6,674,900
-----------

## <1月12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	5,426,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,394,500
日銀当座預金残高増減前日比	+32,300

## <1月12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		+2,800
財政等要因		-8,200
資金過不足		-5,400
金融調節		
CP等買入	期落	新規
	-600	
国債補完供給	+34,800	-35,300
金融調節合計		-1,100
当座預金増減-②		-6,500

## <1月12日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,388,000
準備預金残高	4,693,500
積み終了先	4,693,500
超過準備	4,693,500
非準備先残高	694,500

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,033,600
今積み期間所要準備額(平均)	130,100
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(%)	96.8
進捗率乖離幅	+3.2

## <1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		+1,900
財政等要因		-14,900
資金過不足		-13,000
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
	-200	
国債補完供給	+35,300	
金融調節合計		+35,100
当座預金増減		+22,100

## <1月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残541兆100億円)で 無担保コール0/Nは-0.030%~-0.010% での合いが中心か。
---

## <1月15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	5,455,100	+67,100
+40,000	5,450,100	+62,100
+35,000	5,445,100	+57,100
+30,000	5,440,100	+52,100
+25,000	5,435,100	+47,100
+20,000	5,430,100	+42,100
+15,000	5,425,100	+37,100
+10,000	5,420,100	+32,100
+5,000	5,415,100	+27,100
±0	5,410,100	+22,100
-5,000	5,405,100	+17,100
-10,000	5,400,100	+12,100
-15,000	5,395,100	+7,100
-20,000	5,390,100	+2,100
-25,000	5,385,100	-2,900
-30,000	5,380,100	-7,900
-35,000	5,375,100	-12,900
-40,000	5,370,100	-17,900
-45,000	5,365,100	-22,900

## <1月12日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 1/12-24/ 1/15	応札 35,441億 落札 35,441億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	24/ 1/12-24/ 1/15	応札 0億 落札 0億

## <1月12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
99,653	9,511	成長基盤強化支援資金供給	1,001
1/10~ 1/23 8,432.	1/10(1-3Y) 3,752.	貸出増加支援資金供給	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	1/10(3-5Y) 4,256.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	1/10(10-25Y) 1,503.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.		9/ 2~ 9/ 2 1,804.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.		12/ 2~12/ 2 1,712.	2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.	5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.	8/18~ 8/18 0.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.	11/17~11/17 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.	0百万ドル
			1/11~ 1/18 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
			16,426百万ドル
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.
			12/ 4~12/ 4 3,325.
			国債買現先オペ
			0
			国債売現先(米ドルオペ用担保)
			0
			国庫短期証券買入額(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
			CP買入額(月初来)
			0
			(1/16 3,980.)
			社債買入額(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
			国債補完供給
			35,441
			1/12~ 1/15 35,441.
			1/12~ 1/15 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
			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。
			<1月12日 日銀信用概算(除く買切)>
			共通担保(全)固定 99,653 CP等買入(推定) 21,500
			共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 60,300
			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 62,648
			成長基盤支援 30,589 手形売出 0
			貸出増加支援 730,665 国債売現先 0
			供給オペ合計 994,591 国債補完供給 35,441
			貸出(推定) 0 国債売現先(米ドル担保) 0
			供給額合計 994,591 吸収額合計 35,441
			差し引き 959,150

## <1月12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	-----	3M	買気配 -0.150
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.150
2W	売気配 -0.020	3M	+0.080000	1Y	買気配 -0.050
1M	売気配 -0.020				

## <1月11日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	198,851	+6,235
有担保	26,015	+756
無担保	172,836	+5,479

## <1月12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	-0.075	0.010	-0.010	+0.004				-----	-0.096	-0.001
トムネ			-0.009	-0.003				-----	-0.103	+0.004
スポネ				-----				-----		
1週間物			-0.010	+0.024				-----	-0.121	+0.001
2週間物	-0.003	0.050	0.015	-----				-----	-0.130	-0.001
3週間物				-----				-----	-0.131	+0.001
1ヶ月物	-0.007	0.100	0.014	-----				-----	-0.137	+0.004
3ヶ月物				-----				-----	-0.149	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	-0.095	+0.001
1年物				-----				-----	-0.061	±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