東京短資デイリーレポート　2023/1/6

<1月5日のマネタリーベース>

6,338,200	

<1月6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	5,036,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,044,400
日銀当座預金残高増減前日比	-8,400

<1月6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		+3,200
財政等要因		-66,200
資金過不足		-63,000
金融調節		
	期落	新規
共通担保(全店)		+20,000
CP等買入	-100	
国債補完供給	+31,000	-25,700
金融調節合計		+25,200
当座預金増減-②		-37,800

<1月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,006,600
準備預金残高	4,385,800
積み終了先	4,385,700
超過準備	4,385,700
非準預先残高	620,800

<参考>

今積み期間所要準備額（積数）	3,904,800
今積み期間所要準備額（平均）	126,000
残り要積立額（積数）	200
残り要積立額（平均）	0
準預進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	80.6
進捗率乖離幅	+19.3

<1月10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		+2,700
財政等要因		-24,800
資金過不足		-22,100
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+24,100
共通担保(全店)		+20,000
CP等買入	-100	
国債補完供給	+25,700	
金融調節合計		+69,700
当座預金増減		+47,600

<1月10日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残505兆4,200億円)で
無担保コール0/Nは-0.035%～-0.015%
での出合いが中心か。

<1月10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	5,099,200	+92,600
+40,000	5,094,200	+87,600
+35,000	5,089,200	+82,600
+30,000	5,084,200	+77,600
+25,000	5,079,200	+72,600
+20,000	5,074,200	+67,600
+15,000	5,069,200	+62,600
+10,000	5,064,200	+57,600
+5,000	5,059,200	+52,600
± 0	5,054,200	+47,600
-5,000	5,049,200	+42,600
-10,000	5,044,200	+37,600
-15,000	5,039,200	+32,600
-20,000	5,034,200	+27,600
-25,000	5,029,200	+22,600
-30,000	5,024,200	+17,600
-35,000	5,019,200	+12,600
-40,000	5,014,200	+7,600
-45,000	5,009,200	+2,600

<1月6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)	23/ 1/10	1,500億	応札	7,490億	落札	1,500億	最低	+0.020%	平均	+0.032%	按分 50.0%
(10:10)	国債買入(1Y-3Y)	23/ 1/10	5,000億	応札	11,028億	落札	5,002億	最低	-0.005%	平均	0.000%	按分 48.0%
(10:10)	国債買入(3Y-5Y)	23/ 1/10	5,750億	応札	7,816億	落札	5,753億	最低	-0.023%	平均	-0.013%	按分 2.3%
(10:10)	国債買入(5Y-10Y)	23/ 1/10	3,000億	応札	15,716億	落札	3,005億	最低	0.000%	平均	+0.002%	按分 29.5%
(10:10)	国債買入(10Y-25Y)	23/ 1/10	3,000億	応札	7,088億	落札	3,002億	最低	-0.014%	平均	-0.010%	按分 31.5%
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 1/10		応札	5,937億	落札	5,937億		固定利回較差		0.000%	
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 1/10		応札	0億	落札	0億		固定利回較差		+0.040%	
(11:50)	国債補完供給	23/ 1/ 6-23/ 1/10		応札	26,037億	落札	26,037億	全取	-0.350%	平均	-0.350%	
(13:00)	共通担保(全)固	23/ 1/10-25/ 1/10	20,000億	応札	40,721億	落札	20,011億			貸付	0.000%	按分 49.1%
(13:50)	国債補完供給	23/ 1/ 6-23/ 1/10		応札	30億	落札	30億	全取	-0.350%	平均	-0.350%	

<1月6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
34,690
12/20~ 1/11 4,660.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.
(1/10~ 1/10 20,011.)

国債買現先オペ
0

国債補完供給
26,067
1/ 6~ 1/10 26,037.
1/ 6~ 1/10 30.

国債売現先オペ
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

ETF買入額
354,818
約定 22/12/ 2 701.

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.

国債買入額(月初来)
16,015
12/30(1-3Y) 1,000.
12/30(3-5Y) 1,001.
12/30(5-10Y) 1,009.
12/30(5-10Y) 3,000.
1/ 4(1-3Y) 3,002.
1/ 4(3-5Y) 1,000.
1/ 4(5-10Y) 3,001.
1/ 4(10-25Y) 3,001.
1/ 5(1-3Y) 2,003.
1/ 5(3-5Y) 1,000.
1/ 5(5-10Y) 1,504.
1/ 5(10-25Y) 1,504.
(1/10(-1Y) 1,500.)
(1/10(1-3Y) 5,002.)
(1/10(3-5Y) 5,753.)
(1/10(5-10Y) 3,005.)
(1/10(10-25Y) 3,002.)
※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
12/30(1-3Y) 460.
12/30(3-5Y) 74.
(1/10(5-10Y) 5,937.)
※直近約1週間の実施分を記載

貸出支援基金の運営として行うオペレーション

成長基盤強化支援資金供給
55,060
3/ 4~ 3/ 3 2,859.
3/ 6~ 3/ 6 1.
6/ 4~ 6/ 2 4,312.
6/ 5~ 6/ 5 5.
9/ 3~ 9/ 1 1,940.
9/ 4~ 9/ 4 34.
12/ 4~12/ 4 10,258.
3/ 4~ 3/ 4 2,178.
※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
17,925百万ﾄﾞﾙ
3/ 4~ 3/ 3 2,369.
6/ 3~ 6/ 2 5,848.
9/ 2~ 9/ 5 6,101.
12/ 2~12/ 4 3,607.

新型コロナ企業金融支援
103,947
7/29~ 1/27 5,973.
8/31~ 2/28 11,713.
9/28~ 3/31 73,020.
10/27~ 1/27 2,095.
11/30~ 2/28 2,788.
12/23~ 3/31 8,358.

貸出増加支援資金供給
682,240
3/18~ 3/17 37,714.
6/19~ 6/19 28,033.
9/17~ 9/15 13,014.
12/16~12/15 20,601.
※直近約1年分の期落ち分を記載

米ドル資金供給オペ
0百万ﾄﾞﾙ
12/29~ 1/12 0.

ＣＰ買入額(月初来)
0

社債買入額(月初来)
0

被災地金融機関支援資金供給
2,638
2/19~ 2/17 0.
3/19~ 2/17 0.
4/16~ 2/17 1,268.
5/14~ 5/12 300.
6/11~ 5/12 596.
8/20~ 8/18 0.
11/19~11/17 0.
2/18~ 2/16 0.
5/17~ 5/17 0.
8/19~ 8/19 381.
11/18~11/18 93.

気候変動対応支援資金供給
36,436
12/24~ 1/30 20,483.
7/21~ 7/21 15,953.

<1月6日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	34,690	CP等買入(推定)	25,600
国債買現先	0	社債等買入(推定)	81,900
被災地金融機関支援	2,638		
気候変動対応支援	36,436		
成長基盤支援	50,442		
貸出増加支援	608,567	手形売出	0
新型コロナ企業金融支援	103,947	国債売現先	0
供給オペ合計	836,720	国債補完供給	26,067
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	836,720	吸収額合計	26,067
差し引き	810,653		

※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6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	+0.015000	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	+0.001000	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	------	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

<1月5日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	168,453	+8,728
有担保	28,664	+30
無担保	139,789	+8,698

<1月6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	-0.080	0.001	-0.015	+0.024				------	-0.091	+0.002
トムネ				------				------	-0.095	± 0
スポネ				------				------		
1週間物				------				------	-0.103	+0.001
2週間物				------				------	-0.111	+0.001
3週間物			0.040	------				------	-0.114	+0.003
1ヶ月物			0.480	+0.508				------	-0.123	+0.001
3ヶ月物				------				------	-0.127	+0.002
6ヶ月物				------				------	-0.108	+0.006
1年物				------				------	-0.098	+0.001

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