

東京短資デイリーレポート

2023/1/16

<1月13日のマナリーベース>

6,342,900

<1月16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	5,162,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,062,100
日銀当座預金残高増減前日比	+100,800

<1月16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	+1,800
財政等要因	-24,900
資金過不足	-23,100
金融調節	
国債買入	+49,400
共通担保(全店)	+20,000
CP等買入	-500
国債補完供給	+50,900
金融調節合計	+45,700
当座預金増減-②	+22,600

<1月16日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,084,700
準備預金残高	4,442,900
積み終了先	2,747,400
超過準備	1,142,700
非準備先残高	641,800

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,910,200
今積み期間所要準備額(平均)	126,100
残り要積立額(積数)	610,000
残り要積立額(平均)	20,300
準備進捗率(%)	84.3
日数進捗率(%)	3.2
進捗率乖離幅	+81.1

<1月17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	+1,700
財政等要因	+8,200
資金過不足	+9,900
金融調節確定分	
国債買入	+21,200
CP等買入	-100
国債補完供給	+78,100
金融調節合計	+99,200
当座預金増減	+109,100

<1月17日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残519兆3,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.035%~-0.015% での合いが中心か。

<1月17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	5,238,800	+154,100
+40,000	5,233,800	+149,100
+35,000	5,228,800	+144,100
+30,000	5,223,800	+139,100
+25,000	5,218,800	+134,100
+20,000	5,213,800	+129,100
+15,000	5,208,800	+124,100
+10,000	5,203,800	+119,100
+5,000	5,198,800	+114,100
±0	5,193,800	+109,100
-5,000	5,188,800	+104,100
-10,000	5,183,800	+99,100
-15,000	5,178,800	+94,100
-20,000	5,173,800	+89,100
-25,000	5,168,800	+84,100
-30,000	5,163,800	+79,100
-35,000	5,158,800	+74,100
-40,000	5,153,800	+69,100
-45,000	5,148,800	+64,100

<1月16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)	23/ 1/17	1,000億	応札 2,706億	落札 1,000億	最低 0.000%	平均 +0.004%	按分 4.8%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 1/17	5,000億	応札 11,485億	落札 5,002億	最低 -0.028%	平均 -0.023%	按分 42.3%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 1/17	5,000億	応札 11,448億	落札 5,000億	最低 -0.041%	平均 -0.028%	按分 59.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 1/17	3,000億	応札 5,488億	落札 3,001億	最低 -0.037%	平均 -0.026%	按分 80.0%
(10:10) 国債買入(固)(1Y-3Y)	23/ 1/17		応札 0億	落札 0億	固定利回差	0.000%	
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 1/17		応札 2,149億	落札 2,149億	固定利回差	0.000%	
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 1/17		応札 4,996億	落札 4,996億	固定利回差	0.000%	
(11:50) 国債補完供給	23/ 1/16-23/ 1/17		応札 75,330億	落札 75,330億	全取	-0.350%	平均 -0.563%
(13:50) 国債補完供給	23/ 1/16-23/ 1/17		応札 4,199億	落札 4,199億	全取	-0.350%	平均 -0.543%

<1月16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	91,417	国債買入額(月初末)	77,862	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	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	1/10(-1Y)	1,500.	55,060	682,240	2/19~ 2/17	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	1/10(1-3Y)	5,002.	3/ 4~ 3/ 3	2,859.	3/19~ 2/17	0.
1/10~ 1/10	20,011.	1/10(3-5Y)	5,753.	6/ 3~ 6/ 6	1.	6/19~ 6/19	28,033.
1/11~ 1/25	1,359.	1/10(5-10Y)	3,005.	6/ 4~ 6/ 2	4,312.	9/17~ 9/15	13,014.
1/13~ 1/14	20,008.	1/10(10-25Y)	3,002.	6/ 5~ 6/ 5	5.	12/16~12/15	20,601.
1/16~ 1/16	20,009.	1/12(1-3Y)	1,001.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.		
		1/12(3-5Y)	1,001.	9/ 4~ 9/ 4	34.		
		1/12(5-10Y)	3,010.	12/ 4~12/ 4	10,258.		
		1/12(10-25Y)	2,002.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.		
		1/12(25Y-)	502.				
		1/13(1-3Y)	5,004.				
		1/13(5-10Y)	7,752.				
		1/13(10-25Y)	3,002.				
		1/13(25Y-)	2,002.				
		1/16~ 1/17	75,330.				
		1/16~ 1/17	4,199.				
		1/16(1-3Y)	1,001.				
		1/16(3-5Y)	5,002.				
		1/16(5-10Y)	5,002.				
		1/16(10-25Y)	3,002.				
		1/16(3-5Y)	1,001.				
		1/16(5-10Y)	2,000.				
		1/16(10-25Y)	1,001.				
		(1/17(1-3Y)	1,000.)				
		(1/17(3-5Y)	5,002.)				
		(1/17(5-10Y)	5,000.)				
		(1/17(10-25Y)	3,001.)				
		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(月初末)	1,000				
		1/13	1,000.				
		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(固定利回)(月初末)	73,403				
		1/10(5-10Y)	5,937.				
		1/11(5-10Y)	2,628.				
		1/12(5-10Y)	4,680.				
		1/13(5-10Y)	25,084.				
		1/13(5-10Y)	3,000.				
		1/16(5-10Y)	12,511.				
		1/16(5-10Y)	19,563.				
		(1/17(5-10Y)	2,149.)				
		(1/17(5-10Y)	4,996.)				
		CP買入額(月初末)	3,990				
		1/16	3,990.				
		社債買入額(月初末)	0				
		貸出増加支援	608,567				
		手形売出	0				
		新設コロナ企業金融支援	103,947				
		国債売現先	0				
		供給オペ合計	893,447				
		国債補完供給	79,529				
		貸出(推定)	0				
		国債売現先(米ドル担保)	0				
		供給額合計	893,447				
		吸収額合計	79,529				
		差し引き	813,918				
		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16日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	91,417	CP等買入(推定)	28,300
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		
新設コロナ企業金融支援	103,947		
国債売現先	0		
供給オペ合計	893,447		
国債補完供給	79,529		
貸出(推定)	0		
国債売現先(米ドル担保)	0		
供給額合計	893,447		
吸収額合計	79,529		
差し引き	813,918		

※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16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 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	+0.003000	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13日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	179,305	+693
有担保	29,360	-1,167
無担保	149,945	+1,860

<1月16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	0.001	-0.026	+0.009					-0.096	±0
トムネ				-----					-0.112	-0.005
スポネ				-----						
1週間物	-0.030	-0.008	-0.026	+0.022					-0.119	-0.007
2週間物	-0.032	0.000	-0.021	+0.009					-0.126	-0.008
3週間物				-----					-0.129	-0.006
1ヶ月物	-0.020	0.000	-0.017						-0.133	-0.004
3ヶ月物				-----					-0.132	-0.003
6ヶ月物				-----					-0.106	+0.001
1年物				-----					-0.087	+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