

東京短資デイリーレポート

2023/1/18

<1月17日のマネタリーベース>

6,386,600

<1月18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	5,203,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,109,300
日銀当座預金残高増減前日比	+94,100

<1月18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	+1,200
財政等要因	+1,300
資金過不足	+2,500
金融調節	
国債買入	+8,800
国庫短期証券買入	+1,000
CP等買入	-400
国債補完供給	+85,000
金融調節合計	+11,600
当座預金増減-②	+14,100

<1月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,123,400
準備預金残高	4,478,300
積み終了先	4,456,000
超過準備	4,433,800
非準備先残高	645,100

<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)	53,600
残り要積立額 (平均)	1,900
準備進捗率(%)	98.6
日数進捗率(%)	9.7
進捗率乖離幅	+88.9

<1月19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	+400
財政等要因	+4,300
資金過不足	+4,700
金融調節確定分	
国債買入	+700
共通担保(全店)	+1,200
国債補完供給	+82,800
金融調節合計	+84,700
当座預金増減	+89,400

<1月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残521兆2,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.005% での合いが中心か。

<1月19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	5,257,800	+134,400
+40,000	5,252,800	+129,400
+35,000	5,247,800	+124,400
+30,000	5,242,800	+119,400
+25,000	5,237,800	+114,400
+20,000	5,232,800	+109,400
+15,000	5,227,800	+104,400
+10,000	5,222,800	+99,400
+5,000	5,217,800	+94,400
±0	5,212,800	+89,400
-5,000	5,207,800	+84,400
-10,000	5,202,800	+79,400
-15,000	5,197,800	+74,400
-20,000	5,192,800	+69,400
-25,000	5,187,800	+64,400
-30,000	5,182,800	+59,400
-35,000	5,177,800	+54,400
-40,000	5,172,800	+49,400
-45,000	5,167,800	+44,400

<1月18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(国)(5Y-10Y)	23/ 1/19	応札 320億 落札 320億	固定利回較差 0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 1/19	応札 380億 落札 380億	固定利回較差 -0.005%
(11:50) 国債補完供給	23/ 1/18-23/ 1/19	応札 83,984億 落札 83,984億 全取 -0.350% 平均 -0.411%	
(13:00) 共通担保(全)国	23/ 1/19-25/ 1/20 10,000億	応札 1,163億 落札 1,163億	貸付 0.000%
(13:50) 国債補完供給	23/ 1/18-23/ 1/19	応札 330億 落札 330億 全取 -0.350% 平均 -0.350%	
(14:00) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 1/19	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 0.000%
(14:00) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 1/19	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 -0.005%

<1月18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(月初末)	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	
91,417	91,865	成長基盤強化支援資金供給	2,638	
1/5~1/6 10,016.	1/12(1-3Y) 1,001.	55,060	682,240	2/19~ 2/17 0.
1/6~1/6 20,014.	1/12(3-5Y) 1,001.	3/4~3/3 2,859.	3/18~ 3/17 37,714.	3/19~ 2/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	1/12(5-10Y) 3,010.	3/6~3/6 1.	6/19~ 6/19 28,033.	4/16~ 2/17 1,268.
1/11~ 1/25 1,359.	1/12(10-25Y) 2,002.	6/4~6/2 4,312.	9/17~ 9/15 13,014.	5/14~ 5/12 300.
1/13~ 1/14 20,008.	1/12(25Y-) 502.	6/5~6/5 5.	12/16~12/15 20,601.	6/11~ 5/12 596.
1/16~ 1/16 20,009.	1/13(1-3Y) 5,004.	9/3~9/1 1,940.		8/20~ 8/18 0.
(1/19~ 1/20 1,163.)	1/13(5-10Y) 7,752.	9/4~9/4 34.		11/19~11/17 0.
	1/13(10-25Y) 3,002.	12/4~12/4 10,258.		2/18~ 2/16 0.
国債買入先オペ	1/13(25Y-) 2,002.	3/4~3/4 2,178.		5/17~ 5/17 0.
	1/13(変国) 300.			8/19~ 8/19 381.
	1/16(1-3Y) 1,001.			11/18~11/18 93.
	1/16(3-5Y) 5,002.			
国債補完供給	1/16(5-10Y) 5,002.			
84,314	1/16(10-25Y) 3,002.	17,925百万ドル		
1/18~ 1/19 83,984.	1/16(3-5Y) 1,001.	3/4~3/3 2,369.		
1/18~ 1/19 330.	1/16(5-10Y) 2,000.	6/3~6/2 5,848.		
	1/16(10-25Y) 1,001.	9/2~9/5 6,101.		
	1/17(1-3Y) 1,000.	12/2~12/4 3,607.		
	1/17(3-5Y) 5,002.			
国債売入先オペ	1/17(5-10Y) 5,000.			
0	1/17(10-25Y) 3,001.	103,947		
		7/29~ 1/27 5,973.		
		8/31~ 2/28 11,713.		
		9/28~ 3/31 73,020.		
国債売入先(米ドルオペ用担保)		10/27~ 1/27 2,095.		
0		11/30~ 2/28 2,788.		
		12/23~ 3/31 8,358.		
国債買入額(固定利回)(月初末)	89,513			
	1/11(5-10Y) 2,628.			
国庫短期証券買入額(月初末)	1/12(5-10Y) 4,680.			
2,000	1/13(5-10Y) 25,084.			
1/13 1,000.	1/13(5-10Y) 3,000.			
1/18 1,000.	1/16(5-10Y) 12,511.			
	1/16(5-10Y) 19,563.			
	1/17(5-10Y) 2,149.			
	1/17(5-10Y) 4,996.			
	1/18(5-10Y) 4,288.			
	1/18(5-10Y) 4,677.			
ETF買入額	1/19(5-10Y) 320.)			
354,818	(1/19(5-10Y) 380.)			
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.				

※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18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 +0.030000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M +0.035000	6M 買気配 -0.100
2W 売気配 -0.020	3M +0.050000	1Y 買気配 -0.030
1M 売気配 -0.020		

<1月17日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	200,258	+11,638
有担保	30,284	+1,010
無担保	169,974	+10,628

<1月18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	-0.070	0.001	-0.011	+0.003					-0.098	-0.003
トムネ									-0.122	-0.005
スポネ			-0.005	±0						
1週間物	-0.023	-0.005	-0.014	+0.006					-0.129	-0.003
2週間物	-0.027	-0.003	-0.017	+0.005					-0.137	-0.001
3週間物									-0.141	-0.004
1ヶ月物									-0.143	±0
3ヶ月物									-0.136	-0.003
6ヶ月物									-0.103	+0.003
1年物									-0.081	+0.005

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