

# 東京短資デイリーレポート

2023/3/8

## <3月7日のマナリーベース>

6,464,100
-----------

## <3月8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	5,252,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,194,500
日銀当座預金残高増減前日比	+58,100

## <3月8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		+500
財政等要因		-3,200
資金過不足		-2,700
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+300
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-4,300	+6,500
CP等買入	-100	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+46,800	-48,000
金融調節合計		+2,100
当座預金増減-②		-600

## <3月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,193,900
準備預金残高	4,536,700
積み終了先	4,536,600
超過準備	4,536,600
非準備先残高	657,200

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,515,000
今積み期間所要準備額(平均)	125,500
残り要積立額(積数)	400
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	75.0
進捗率乖離幅	+24.9

## <3月9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		-300
財政等要因		+2,700
資金過不足		+2,400
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+27,700
CP等買入	-100	
国債補完供給	+57,500	
金融調節合計		+85,100
当座預金増減		+87,500

## <3月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残528兆1,400億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.005% での合いが中心か。
---

## <3月9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	5,326,400	+132,500
+40,000	5,321,400	+127,500
+35,000	5,316,400	+122,500
+30,000	5,311,400	+117,500
+25,000	5,306,400	+112,500
+20,000	5,301,400	+107,500
+15,000	5,296,400	+102,500
+10,000	5,291,400	+97,500
+5,000	5,286,400	+92,500
±0	5,281,400	+87,500
-5,000	5,276,400	+82,500
-10,000	5,271,400	+77,500
-15,000	5,266,400	+72,500
-20,000	5,261,400	+67,500
-25,000	5,256,400	+62,500
-30,000	5,251,400	+57,500
-35,000	5,246,400	+52,500
-40,000	5,241,400	+47,500
-45,000	5,236,400	+42,500

## <3月8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/ 3/ 9	4,250億	応札 10,309億	落札 4,254億	最低 +0.001%	平均 +0.002%	按分 57.8%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 3/ 9	5,000億	応札 9,267億	落札 5,005億	最低 +0.003%	平均 +0.004%	按分 60.7%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 3/ 9	6,750億	応札 15,308億	落札 6,755億	最低 0.000%	平均 +0.004%	按分 14.7%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 3/ 9	3,000億	応札 4,051億	落札 3,000億	最低 +0.010%	平均 +0.018%	按分 22.5%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 9		応札 8,594億	落札 8,594億	固定利回差	0.000%	
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 9		応札 0億	落札 0億	固定利回差	+0.100%	
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 9		応札 0億	落札 0億	固定利回差	+0.055%	
(10:40) C P 買入	23/ 3/13	4,000億	応札 7,540億	落札 3,980億	最低 +0.003%	平均 +0.013%	按分 68.1%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/ 8-23/ 3/ 9		応札 11,666億	落札 11,666億	全取 -1.100%	平均 -3.325%	
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/ 8-23/ 3/ 9		応札 36,558億	落札 36,558億	全取 -0.350%	平均 -0.388%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 3/ 8-23/ 3/ 9		応札 92億	落札 92億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	

## <3月8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
9 7,6 8 1	1 4, 7 7 9	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	3/ 6(-1Y) 1,501.	5 2, 2 0 0	6 8 2, 2 4 0
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	3/ 6(1-3Y) 4,254.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	3/18~ 3/17 37,714.
1/10~ 1/10 20,011.	3/ 6(3-5Y) 5,003.	6/ 5~ 6/ 5 5.	6/19~ 6/19 28,033.
1/13~ 1/14 20,008.	3/ 6(10-25Y) 3,011.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	9/17~ 9/15 13,014.
1/16~ 1/16 20,009.	3/ 6(25Y-) 1,010.	9/ 4~ 9/ 4 34.	12/16~12/15 20,601.
1/19~ 1/20 1,163.	(3/ 9(1-3Y) 4,254.)	12/ 4~12/ 4 10,258.	
3/ 8~ 3/22 6,460.	(3/ 9(3-5Y) 5,005.)	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	
	(3/ 9(5-10Y) 6,755.)	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	
	(3/ 9(10-25Y) 3,000.)	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	
		※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	
		1 7, 7 0 9 百万ドル	
		6/ 3~ 6/ 2 5,848.	
		9/ 2~ 9/ 5 6,101.	
		12/ 2~12/ 4 3,607.	
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
		国債買現先オペ	
		0	
		国債売現先オペ	
		0	
		社債買入額(月初来)	
		0	
		社債買入額(月初来)	
		0	
		ETF買入額	
		3 5 4, 8 1 8	
		約定 22/12/ 2 701.	
		ETF買入額(企業支援)	
		1 4, 6 2 8	
		約定 21/ 3/31 12.	
		J-REIT買入額	
		6, 8 2 3	
		約定 22/ 6/14 12.	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		国債買現先	
		0	
		被災地金融機関支援	
		1, 7 1 6	
		成長基盤強化支援	
		4 4, 2 1 4	
		貸出増加支援	
		608, 5 6 7	
		手形売出	
		0	
		供給オペ合計	
		889, 3 9 6	
		国債補完供給	
		4 8, 3 1 6	
		貸出(推定)	
		0	
		供給額合計	
		889, 3 9 6	
		吸収額合計	
		4 8, 3 1 8	
		差し引き	
		8 4 1, 0 7 8	

※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。

## <3月8日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	NCD/CP現先	CPプライマリー	TBアウトライト
S/N	0.000	1M +0.003000	3M 買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M -----	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		

## <3月7日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	217,141	+12,335
有担保	30,760	+2,529
無担保	186,381	+9,806

## <3月8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	-0.060	0.001	-0.012	-0.001	-----	-----	-----	-----	-0.089	+0.002
トムネ			-0.010	±0	-----	-----	-----	-----	-0.096	+0.001
スポネ			-0.009	-0.001	-----	-----	-----	-----		
1週間物	-0.040	-0.009	-0.031	-0.005	-----	-----	-----	-----	-0.111	-0.003
2週間物			-0.007	+0.021	-----	-----	-----	-----	-0.121	-0.003
3週間物			-----	-----	-----	-----	-----	-----	-0.134	-0.004
1ヶ月物			-----	-----	-----	-----	-----	-----	-0.166	-0.003
3ヶ月物			-----	-----	-----	-----	-----	-----	-0.151	+0.001
6ヶ月物			-----	-----	-----	-----	-----	-----	-0.113	-0.005
1年物			-----	-----	-----	-----	-----	-----	-0.085	-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