

# 東京短資デイリーレポート

2023/3/9

## <3月8日のマナリーベース>

6,462,900
-----------

## <3月9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	5,281,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,193,800
日銀当座預金残高増減前日比	+87,600

## <3月9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		-300
財政等要因		+600
資金過不足		+300
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+27,700
CP等買入	-100	
国債補充供給	+47,500	-58,400
金融調節合計		+16,700
当座預金増減-②		+17,000

## <3月9日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,210,800
準備預金残高	4,550,800
積み終了先	4,550,700
超過準備	4,550,700
非準備先残高	660,000

## <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)	300
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	78.6
進捗率乖離幅	+21.3

## <3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		+500
財政等要因		-100
資金過不足		+400
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+1,600
CP等買入	-300	
社債等買入	-900	
国債補充供給	+68,000	
金融調節合計		+68,400
当座預金増減		+68,800

## <3月10日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残527兆9,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.030%~-0.010% での合いが中心か。
---

## <3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	5,324,600	+113,800
+40,000	5,319,600	+108,800
+35,000	5,314,600	+103,800
+30,000	5,309,600	+98,800
+25,000	5,304,600	+93,800
+20,000	5,299,600	+88,800
+15,000	5,294,600	+83,800
+10,000	5,289,600	+78,800
+5,000	5,284,600	+73,800
±0	5,279,600	+68,800
-5,000	5,274,600	+63,800
-10,000	5,269,600	+58,800
-15,000	5,264,600	+53,800
-20,000	5,259,600	+48,800
-25,000	5,254,600	+43,800
-30,000	5,249,600	+38,800
-35,000	5,244,600	+33,800
-40,000	5,239,600	+28,800
-45,000	5,234,600	+23,800

## <3月9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/ 3/10	応札 1,551億 落札 1,551億	固定利回較差 0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/10	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.095%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/10	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.050%
(11:50) 国債補充供給	23/ 3/ 9-23/ 3/10	応札 11,822億 落札 11,795億 全取	-1.100% 平均 -3.634%
(11:50) 国債補充供給	23/ 3/ 9-23/ 3/10	応札 44,860億 落札 44,860億 全取	-0.350% 平均 -0.364%
(13:50) 国債補充供給	23/ 3/ 9-23/ 3/10	応札 2,146億 落札 2,146億 全取	-0.350% 平均 -0.365%

## <3月9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
97,681	33,793	成長基盤強化支援資金供給	1,716
1/5~1/6 10,016.	3/6(-1Y) 1,501.	貸出増加支援資金供給	5/14~5/12 300.
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.	2/18~2/16 0.
3/8~3/22 6,460.	3/9(3-5Y) 5,005.	3/4~3/4 2,178.	5/17~5/17 0.
	3/9(5-10Y) 6,755.	6/3~6/3 1,950.	8/19~8/19 381.
	3/9(10-25Y) 3,000.	9/2~9/2 1,804.	11/18~11/18 93.
			2/17~2/17 346.
			2百万ドル
			3/9~3/16 2.
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			成長基盤強化支援ドル特別
			17,709百万ドル
			6/3~6/2 5,848.
			9/2~9/5 6,101.
			12/2~12/4 3,607.
			3/3~3/4 2,153.
			国債買入先オペ
			0
			国債売入先オペ
			0
			国債売現先オペ
			0
			CP買入額(月初来)
			0
			(3/13 3,980.)
			社債買入額(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.
			※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)
			32,058
			国庫短期証券買入額(月初来)
			2,000
			3/1 1,000.
			3/3(5-10Y) 17,698.
			3/6(5-10Y) 2,776.
			3/7(5-10Y) 2,650.
			3/8(5-10Y) 320.
			3/9(5-10Y) 8,594.
			(3/10(5-10Y) 1,551.)
			国債買入額(固定利回)(月初来)
			32,058
			国庫短期証券買入額(月初来)
			2,000
			3/1 1,000.
			3/3(5-10Y) 17,698.
			3/6(5-10Y) 2,776.
			3/7(5-10Y) 2,650.
			3/8(5-10Y) 320.
			3/9(5-10Y) 8,594.
			(3/10(5-10Y) 1,551.)
			国債買入額(固定利回)(月初来)
			32,058
			国庫短期証券買入額(月初来)
			2,000
			3/1 1,000.
			3/3(5-10Y) 17,698.
			3/6(5-10Y) 2,776.
			3/7(5-10Y) 2,650.
			3/8(5-10Y) 320.
			3/9(5-10Y) 8,594.
			(3/10(5-10Y) 1,551.)
			国債買入額(固定利回)(月初来)
			32,058
			国庫短期証券買入額(月初来)
			2,000
			3/1 1,000.
			3/3(5-10Y) 17,698.
			3/6(5-10Y) 2,776.
			3/7(5-10Y) 2,650.
			3/8(5-10Y) 320.
			3/9(5-10Y) 8,594.
			(3/10(5-10Y) 1,551.)
			国債買入額(固定利回)(月初来)
			32,058
			国庫短期証券買入額(月初来)
			2,000
			3/1 1,000.
			3/3(5-10Y) 17,698.
			3/6(5-10Y) 2,776.
			3/7(5-10Y) 2,650.
			3/8(5-10Y) 320.
			3/9(5-10Y) 8,594.
			(3/10(5-10Y) 1,551.)

※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9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 -0.100
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.150
2W 売気配 -0.020	3M +0.040000	1Y 買気配 -0.100
1M 売気配 -0.020		

## <3月8日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	213,721	-3,420
有担保	31,491	+731
無担保	182,230	-4,151

## <3月9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	-0.065	0.001	-0.017	-0.005					-0.092	-0.003
トムネ			-0.012	-0.002					-0.099	-0.003
スポネ			-0.009	±0						
1週間物									-0.113	-0.002
2週間物									-0.129	-0.008
3週間物			0.120						-0.141	-0.007
1ヶ月物			0.130						-0.170	-0.004
3ヶ月物									-0.152	-0.001
6ヶ月物									-0.110	+0.003
1年物									-0.086	-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