

東京短資デイリーレポート

2024/1/9

<1月5日のマナリーベース>

6,733,600

<1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	5,453,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,445,400
日銀当座預金残高増減前日比	+7,900

<1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		+3,200
財政等要因		-33,500
資金過不足		-30,300
金融調節		
国債補充供給	期落	新規
	+43,300	-39,700
金融調節合計		+3,600
当座預金増減-②		-26,700

<1月9日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,418,700
準備預金残高	4,724,400
積み終了先	4,724,200
超過準備	4,724,200
非準備先残高	694,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,969,100
今積み期間所要準備額 (平均)	128,000
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(%)	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		-2,900
資金過不足		-200
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
		+9,500
共通担保(全店)	-12,600	+8,400
CP等買入		-400
社債等買入		-100
国債補充供給	+39,700	
金融調節合計		+44,500
当座預金増減		+44,300

<1月10日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残546兆3,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.030%~-0.010% での合いが中心か。

<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	5,508,000	+89,300
+40,000	5,503,000	+84,300
+35,000	5,498,000	+79,300
+30,000	5,493,000	+74,300
+25,000	5,488,000	+69,300
+20,000	5,483,000	+64,300
+15,000	5,478,000	+59,300
+10,000	5,473,000	+54,300
+5,000	5,468,000	+49,300
± 0	5,463,000	+44,300
-5,000	5,458,000	+39,300
-10,000	5,453,000	+34,300
-15,000	5,448,000	+29,300
-20,000	5,443,000	+24,300
-25,000	5,438,000	+19,300
-30,000	5,433,000	+14,300
-35,000	5,428,000	+9,300
-40,000	5,423,000	+4,300
-45,000	5,418,000	-700

<1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(1Y-3Y)	24/ 1/10	3,750億 応札 9,233億 落札 3,752億 最低 -0.009% 平均 -0.008% 按分 85.6%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 1/10	4,250億 応札 8,678億 落札 4,256億 最低 -0.009% 平均 -0.008% 按分 97.9%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 1/10	1,500億 応札 3,288億 落札 1,503億 最低 -0.015% 平均 -0.011% 按分 29.6%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 1/11-24/ 1/18	応札 0mil 落札 0mil 貸付 5.580%
(11:50) 国債補充供給	24/ 1/ 9-24/ 1/10	応札 39,661億 落札 39,661億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:00) 共通担保(全)固	24/ 1/10-24/ 1/23	応札 8,432億 落札 8,432億 貸付 0.000%
(13:50) 国債補充供給	24/ 1/ 9-24/ 1/10	応札 152億 落札 152億 全取 -0.350% 平均 -0.350%

<1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	
1 0 3, 8 4 3	0	成長基盤強化支援資金供給	1, 0 0 1	
12/19~ 1/10 12,622.	(1/10(1-3Y) 3,752.)	3 5, 6 5 1	8 0 7, 1 3 9	2/18~ 2/16 0.
(1/10~ 1/23 8,432.)	(1/10(3-5Y) 4,256.)	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	(1/10(10-25Y) 1,503.)	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.		9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/10~ 1/10 20,011.		12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/13~ 1/14 20,008.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.		6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
		12/ 1~12/ 1 2,464.		
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			12/28~ 1/11 0.	
			(1/11~ 1/18 0.)	
			※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 6, 4 2 6 百万ドル	
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.	
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.	
			12/ 4~12/ 4 3,325.	
			国債買現先オペ	
			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
				国債売現先オペ
				0
				CP買入額(月初来)
				0
				社債買入額(月初来)
				0
				ETF買入額
				3 5 6, 9 2 1
				約定 23/10/ 4 701.
				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

※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 +0.030000	3M 買気配 -0.150
1W 売気配 -0.020	2M +0.035000	6M 買気配 -0.150
2W 売気配 -0.020	3M +0.009000	1Y 買気配 -0.050
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	180,502	+11,368
有担保	26,655	-195
無担保	153,847	+11,563

<1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	-0.080	0.001	-0.017	+0.001					-0.089	-0.002
トムネ			-0.018	-0.005					-0.097	-0.001
スポネ										
1週間物	-0.035	0.001	-0.018	+0.007					-0.118	-0.002
2週間物	-0.026	-0.008	-0.022	+0.001					-0.126	-0.002
3週間物			0.001						-0.131	-0.002
1ヶ月物			0.255	+0.266					-0.135	-0.002
3ヶ月物			0.018	-0.002					-0.142	-0.003
6ヶ月物									-0.096	+0.001
1年物									-0.061	± 0

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る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