

# 東京短資デイリーレポート

2024/1/26

## <1月25日のマナリーベース>

6,660,100
-----------

## <1月26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	5,431,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,393,800
日銀当座預金残高増減前日比	+37,400

## <1月26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	+400
財政等要因	-4,000
資金過不足	-3,600
金融調節	
CP等買入	-400
社債等買入	-200
国債補完供給	+37,300
金融調節合計	+3,200
当座預金増減-②	-400

## <1月26日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,393,400
準備預金残高	4,700,800
積み終了先	4,698,900
超過準備	4,698,500
非準備先残高	692,600

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,040,400
今積み期間所要準備額 (平均)	130,300
残り要積立額 (積数)	13,100
残り要積立額 (平均)	700
準備進捗率(%)	99.6
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+57.7

## <1月29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	+600
財政等要因	+11,100
資金過不足	+11,700
金融調節確定分	
CP等買入	-100
国債補完供給	+33,500
金融調節合計	+33,400
当座預金増減	+45,100

## <1月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残543兆8,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。
---

## <1月29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	5,483,500	+90,100
+40,000	5,478,500	+85,100
+35,000	5,473,500	+80,100
+30,000	5,468,500	+75,100
+25,000	5,463,500	+70,100
+20,000	5,458,500	+65,100
+15,000	5,453,500	+60,100
+10,000	5,448,500	+55,100
+5,000	5,443,500	+50,100
± 0	5,438,500	+45,100
-5,000	5,433,500	+40,100
-10,000	5,428,500	+35,100
-15,000	5,423,500	+30,100
-20,000	5,418,500	+25,100
-25,000	5,413,500	+20,100
-30,000	5,408,500	+15,100
-35,000	5,403,500	+10,100
-40,000	5,398,500	+5,100
-45,000	5,393,500	+100

## <1月26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。

(10:40) C P買入	24/ 1/31	4,000億	応札 7,790億	落札 3,965億	最低 +0.003%	平均 +0.012%	按分 23.6%
(11:50) 国債補完供給	24/ 1/26-24/ 1/29		応札 33,870億	落札 33,870億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:50) 国債補完供給	24/ 1/26-24/ 1/29		応札 0億	落札 0億			

## <1月26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)	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
99,673	48,800	35,651	807,139	1,001
1/23~ 2/ 7 8,452.	1/22(1-3Y) 3,752.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	1/22(3-5Y) 4,252.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	1/22(5-10Y) 4,753.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.	1/22(25Y-) 754.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.	1/25(1-3Y) 3,754.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.	1/25(3-5Y) 4,252.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	1/25(5-10Y) 4,754.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		8/18~ 8/18 0.
	1/25(10-25Y) 1,500.	12/ 1~12/ 1 2,464.		11/17~11/17 0.
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			1/25~ 2/ 1 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	
			16,426百万ドル	
			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)	
			国債売現先オペ	
			0	
			1/25 1,000.	
			※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)	
			0	
			国債補完供給	
			33,870	
			1/26~ 1/29 33,870.	
			1/26~ 1/29 0.	
			ETF買入額	
			356,921	
			約定 23/10/ 4 701.	
			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	
			C P買入額(月初来)	
			3,980	
			1/16 3,980.	
			(1/31 3,965.)	
			社債買入額(月初来)	
			1,000	
			1/23 1,000.	

## <1月26日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,673	CP等買入(推定)	23,500
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	60,800
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	1,001		
気候変動対応支援	62,648		
成長基盤支援	30,589	手形売出	0
貸出増加支援	730,665	国債売現先	0
供給オペ合計	994,611	国債補完供給	33,870
貸出(推定)	0	国債売現先	0
供給額合計	994,611	吸収額合計	33,870
	差し引き		960,741

※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26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 +0.050000	3M 買気配 -0.150
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.150
2W 売気配 -0.020	3M +0.048000	1Y 買気配 -0.050
1M 売気配 -0.020		

## <1月25日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	200,437	+1,466
有担保	28,077	-291
無担保	172,360	+1,757

## <1月26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	最低	最高	平均	前日比	前日比
翌日物	-0.080	0.001	-0.010	+0.002			-----	-0.080 -0.003
トムネ			-0.009	-0.001			-----	-0.081 -0.001
スポネ							-----	
1週間物			-0.010	+0.004			-----	-0.089 ± 0
2週間物							-----	-0.097 +0.003
3週間物							-----	-0.106 +0.002
1ヶ月物							-----	-0.111 +0.002
3ヶ月物							-----	-0.133 ± 0
6ヶ月物							-----	-0.095 ± 0
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