

# 東京短資デイリーレポート

2024/1/29

## <1月26日のマナリーベース>

6,659,300
-----------

## <1月29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	5,438,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,393,400
日銀当座預金残高増減前日比	+45,100

## <1月29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		+600
財政等要因		+14,600
資金過不足		+15,200
金融調節		
CP等買入	期落	新規
		-100
国債補充供給	+33,500	-36,000
金融調節合計		-2,600
当座預金増減-②		+12,600

## <1月29日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,406,000
準備預金残高	4,715,800
積み終了先	4,714,000
超過準備	4,714,000
非準備先残高	690,200

## <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)	11,200
残り要積立額(平均)	700
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	45.2
進捗率乖離幅	+54.5

## <1月30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		+700
財政等要因		+6,500
資金過不足		+7,200
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
		+10,400
CP等買入		-600
気候変動対応支援	-28,300	+47,300
国債補充供給	+36,000	
金融調節合計		+64,800
当座預金増減		+72,000

## <1月30日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残547兆8,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。
---

## <1月30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	5,523,000	+117,000
+40,000	5,518,000	+112,000
+35,000	5,513,000	+107,000
+30,000	5,508,000	+102,000
+25,000	5,503,000	+97,000
+20,000	5,498,000	+92,000
+15,000	5,493,000	+87,000
+10,000	5,488,000	+82,000
+5,000	5,483,000	+77,000
±0	5,478,000	+72,000
-5,000	5,473,000	+67,000
-10,000	5,468,000	+62,000
-15,000	5,463,000	+57,000
-20,000	5,458,000	+52,000
-25,000	5,453,000	+47,000
-30,000	5,448,000	+42,000
-35,000	5,443,000	+37,000
-40,000	5,438,000	+32,000
-45,000	5,433,000	+27,000

## <1月29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(3Y-5Y)	24/ 1/30	4,250億	応札 11,596億	落札 4,254億	最低 +0.006%	平均 +0.007%	按分 94.0%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 1/30	4,750億	応札 13,145億	落札 4,760億	最低 +0.007%	平均 +0.009%	按分 11.6%
(10:10) 国債買入(25Y)	24/ 1/30	750億	応札 2,428億	落札 753億	最低 +0.022%	平均 +0.025%	按分 60.1%
(10:10) 国債買入(物国)	24/ 1/30	600億	応札 2,770億	落札 602億	按分 -0.720円	平均 -0.863円	按分 23.2%
(11:50) 国債補充供給	24/ 1/29-24/ 1/30		応札 36,285億	落札 36,285億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(13:50) 国債補充供給	24/ 1/29-24/ 1/30		応札 1億	落札 1億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	
(9:30) 気候変動対応支援	24/ 1/30-25/ 1/30		応札 47,268億	落札 47,268億		貸付 0.000%	

## <1月29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)	貸出支援基金の運用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	
99,673	48,800	成長基盤強化支援資金供給	1,001	
1/23~ 2/ 7 8,452.	1/22(1-3Y) 3,752.	35,651	807,139	2/18~ 2/16 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	1/22(3-5Y) 4,252.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	1/22(5-10Y) 4,753.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/10~ 1/10 20,011.	1/22(25Y-) 754.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18~11/18 93.
1/13~ 1/14 20,008.	1/25(1-3Y) 3,754.	12/ 2~12/ 2 1,712.	12/15~12/13 54,701.	2/17~ 2/17 346.
1/16~ 1/16 20,009.	1/25(3-5Y) 4,252.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
1/19~ 1/20 1,163.	1/25(5-10Y) 4,754.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
	1/25(10-25Y) 1,500.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.		11/17~11/17 0.
	(1/30(3-5Y) 4,254.)	12/ 1~12/ 1 2,464.		
	(1/30(5-10Y) 4,760.)			
	(1/30(25Y-) 753.)			
	(1/30(物国) 602.)			
共通担保(全店)金利入札		成長基盤強化支援米ドル特別		気候変動対応支援資金供給
70,035		16,426百万ドル		62,659
1/24~ 1/24 10,003.		3/ 3~ 3/ 4 2,153.		1/30~ 1/30 28,261.
2/ 1~ 2/ 1 10,004.		6/ 2~ 6/ 3 5,566.		7/21~ 7/19 34,398.
2/15~ 2/15 10,004.		9/ 5~ 9/ 5 5,382.		(1/30~ 1/30 47,268.)
3/ 1~ 3/ 1 10,010.		12/ 4~12/ 4 3,325.		
9/15~ 9/15 10,005.		国債買現先オペ		
10/10~10/10 10,006.		0		
10/25~10/25 10,003.		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		0		
		国債短期証券買入額(月初来)		
		0		
		国債売現先オペ		
		0	1/25 1,000.	
		CP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.		
		J-REIT買入額		
		6,823		
		約定 22/ 6/14 12.		
		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.		
		無担保コール買入額		
		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29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 +0.080000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M +0.080000	6M 買気配 -0.130
2W 売気配 -0.020	3M +0.080000	1Y 買気配 -0.030
1M 売気配 -0.020		

## <1月26日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	197,013	-3,424
有担保	26,931	-1,146
無担保	170,082	-2,278

## <1月29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	-0.087	0.001	-0.011	-0.001					-0.080	±0
トムネ			-0.008	+0.001					-0.081	±0
スポネ										
1週間物			-0.020	-0.010					-0.089	±0
2週間物									-0.099	-0.002
3週間物									-0.105	+0.001
1ヶ月物									-0.109	+0.002
3ヶ月物			0.026						-0.128	+0.005
6ヶ月物									-0.093	+0.002
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