

東京短資デイリーレポート

2025/1/20

<1月17日のマネタリーベース>

6,449,000

<1月20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	5,194,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,186,100
日銀当座預金残高増減前日比	+8,600

<1月20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	+1,600
財政等要因	+1,200
資金過不足	+2,800
金融調節	
共通担保(全店)	-1,200
社債等買入	-200
国債補完供給	+7,500
金融調節合計	+400
当座預金増減-②	+3,200

<1月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,189,300
準備預金残高	4,690,000
積み終了先	4,686,200
超過準備	4,680,400
非準備先残高	499,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,074,100
今積み期間所要準備額 (平均)	131,400
残り要積立額 (積数)	27,100
残り要積立額 (平均)	1,000
準備進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	16.1
進捗率乖離幅	+83.2

<1月21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	+1,700
財政等要因	-400
資金過不足	+1,300
金融調節確定分	
国債補完供給	+5,700
金融調節合計	+5,700
当座預金増減	+7,000

<1月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残519兆6,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<1月21日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,241,300	+52,000
+40,000	5,236,300	+47,000
+35,000	5,231,300	+42,000
+30,000	5,226,300	+37,000
+25,000	5,221,300	+32,000
+20,000	5,216,300	+27,000
+15,000	5,211,300	+22,000
+10,000	5,206,300	+17,000
+5,000	5,201,300	+12,000
± 0	5,196,300	+7,000
-5,000	5,191,300	+2,000
-10,000	5,186,300	-3,000
-15,000	5,181,300	-8,000
-20,000	5,176,300	-13,000
-25,000	5,171,300	-18,000
-30,000	5,166,300	-23,000
-35,000	5,161,300	-28,000
-40,000	5,156,300	-33,000
-45,000	5,151,300	-38,000

<1月20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) 社債買入	25/ 1/23	250億 応札	955億 落札	250億 最低 +1.052%	平均 +1.083%	按分 37.6%
(11:50) 国債補完供給	25/ 1/20-25/ 1/21	応札	5,961億 落札	5,961億 全取	-0.050%	平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	25/ 1/20-25/ 1/21	応札	0億 落札	0億		

<1月20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(月初末)	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
8,006	22,291	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
1/ 8~ 1/22 8,006.	1/16(-1Y) 1,503.	28,007	836,939
	1/16(1-3Y) 3,002.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
	1/16(3-5Y) 3,005.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.
	1/16(5-10Y) 3,259.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.
	1/16(25Y-) 751.	12/ 1~12/ 1 2,464.	12/15~12/15 20,129.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
			※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
			1/16~ 1/23 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
			9,918百万ドル
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.
			6/ 3~ 6/ 3 5,318.
			9/ 5~ 9/ 5 1,661.
			12/ 4~12/ 4 842.
			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(月初末)
			0
			国債売現先オペ
			0
			※直近約1週間の実施分を記載
			国債買入額(固定利回)(月初末)
			0
			CP買入額(月初末)
			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
			社債買入額(月初末)
			0
			(1/23 250.)
			国債買現先
			0
			被災地金融機関支援
			863
			気候変動対応支援
			119,626
			成長基盤支援
			24,018
			手形売出
			0
			貸出増加支援
			771,475
			国債売現先
			0
			供給オペ合計
			994,023
			国債補完供給
			5,961
			貸出(推定)
			0
			国売現(米ドル担保)
			0
			供給額合計
			994,023
			吸収額合計
			5,961
			差し引き
			988,062

※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20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	売気配 +0.200	1M +0.509000	3M 買気配 +0.350
1W	売気配 +0.200	2M -----	6M 買気配 +0.450
2W	売気配 +0.200	3M +0.539000	1Y 買気配 +0.550
1M	売気配 +0.200		

<1月17日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	127,890	+1,250
有担保	42,960	+60
無担保	84,930	+1,190

<1月20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	0.220	0.228	0.227	± 0			0.180	± 0	0.248	+0.006
トムネ				-----				-----	0.244	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.232	-0.132				-----	0.255	+0.014
2週間物				-----				-----	0.304	+0.015
3週間物				-----				-----	0.334	+0.014
1ヶ月物				-----				-----	0.369	+0.017
3ヶ月物				-----				-----	0.410	+0.008
6ヶ月物				-----				-----	0.445	+0.011
1年物				-----				-----	0.520	+0.008

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