

東京短資デイリーレポート

2025/1/27

<1月24日のマネタリーベース>

6,489,700

<1月27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	5,248,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,234,300
日銀当座預金残高増減前日比	+13,700

<1月27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	+800
財政等要因	+12,000
資金過不足	+12,800
金融調節	
国債補完供給	+5,200
金融調節合計	-40,300
当座預金増減-②	-27,500

<1月27日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,206,800
準備預金残高	4,693,800
積み終了先	4,692,400
超過準備	4,692,400
非準備先残高	513,000

<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)	10,600
残り要積立額(平均)	600
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	38.7
進捗率乖離幅	+61.0

<1月28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	+1,600
財政等要因	-5,300
資金過不足	-3,700
金融調節確定分	
国債補完供給	+45,500
金融調節合計	+45,500
当座預金増減	+41,800

<1月28日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残524兆8,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での出合いが中心か。
--

<1月28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	5,293,600	+86,800
+40,000	5,288,600	+81,800
+35,000	5,283,600	+76,800
+30,000	5,278,600	+71,800
+25,000	5,273,600	+66,800
+20,000	5,268,600	+61,800
+15,000	5,263,600	+56,800
+10,000	5,258,600	+51,800
+5,000	5,253,600	+46,800
± 0	5,248,600	+41,800
-5,000	5,243,600	+36,800
-10,000	5,238,600	+31,800
-15,000	5,233,600	+26,800
-20,000	5,228,600	+21,800
-25,000	5,223,600	+16,800
-30,000	5,218,600	+11,800
-35,000	5,213,600	+6,800
-40,000	5,208,600	+1,800
-45,000	5,203,600	-3,200

<1月27日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	25/ 1/27-25/ 1/28	応札 47,489億 落札 47,489億 全取 +0.150% 平均 +0.150%
(13:50) 国債補完供給	25/ 1/27-25/ 1/28	応札 100億 落札 100億 全取 +0.150% 平均 +0.150%

<1月27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	
8,006	3,305	成長基盤強化支援資金供給	863	
1/22~ 2/ 5 8,006.	1/23(1-3Y) 3,001. 1/23(3-5Y) 3,002. 1/23(5-10Y) 3,258. 1/23(10-25Y) 1,504.	28,007 3/ 3~ 3/ 3 6,793. 3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/ 4~12/ 4 842.	836,939 3/17~ 3/17 64,498. 6/18~ 6/18 26,498. 6/19~ 6/18 67,646. 9/15~ 9/12 27,659. 9/13~ 9/12 121,454. 12/15~12/15 20,129. 12/13~12/15 33,838. 3/16~ 3/16 38,879.	2/17~ 2/17 346. 5/17~ 5/12 0. 5/12~ 5/12 181. 8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/18~11/17 57. 11/17~11/17 0. 2/16~ 2/16 0.
共通担保(全店)金利入札		米ドル資金供給オペ		
70,035	1/24~ 1/24 10,003. 2/ 1~ 2/ 1 10,004. 2/15~ 2/15 10,004. 3/ 1~ 3/ 1 10,010. 9/15~ 9/15 10,005. 10/10~10/10 10,006. 10/25~10/25 10,003.	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.	3百万ドル 1/23~ 1/30 3. 1/23~ 1/30 47,268. 7/19~ 7/18 72,361.	
国債補完供給		国債売現先オペ		
47,589	1/27~ 1/28 47,489. 1/27~ 1/28 100.	0	0	
ETF買入額		C P買入額(月初来)		
356,921	約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	0	0	
14,628	約定 21/ 3/31 12.	社債買入額(月初来)		
J-REIT買入額	6,823	250	250.	
約定 22/ 6/14 12.	※直近約1週間の実施分を記載			
※直近約1年分の期落ち分を記載				
※直近約1年分の期落ち分を記載				

<1月27日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	8,006	CP等買入(推定)	14,300
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	50,100
国債買現先	0	手形売出	
被災地金融機関支援	863	成長基盤支援	24,018
気候変動対応支援	119,626	貸出増加支援	771,475
成長基盤支援	24,018	貸出増加支援	771,475
貸出増加支援	771,475	供給オペ合計	994,023
供給オペ合計	994,023	国債補完供給	47,589
貸出(推定)	0	貸出(推定)	0
供給額合計	994,023	供給額合計	47,593
差し引き	946,430		

<1月27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	1M	+0.540000	3M	買気配
1W	+0.200	2M	+0.550000	6M	+0.450
2W	+0.200	3M	+0.590000	1Y	+0.550
1M	+0.200				

<1月24日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	123,909	+1,131
有担保	40,228	-775
無担保	83,681	+1,906

<1月27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	0.470	0.478	0.476	+0.249			0.430	+0.250	0.090	-0.142
トムネ				-----				-----	0.240	-0.159
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.476	0.540	0.482	-0.120				-----	0.300	-0.102
2週間物	0.477	0.540	0.479	-0.065				-----	0.342	-0.070
3週間物			0.500	-----				-----	0.380	-0.037
1ヶ月物	0.530	0.680	0.555	+0.003				-----	0.412	-0.011
3ヶ月物	0.585	0.620	0.608	-----				-----	0.436	-0.010
6ヶ月物				-----				-----	0.468	+0.002
1年物				-----				-----	0.550	+0.002

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