

東京短資デイリーレポート

2026/3/23

<3月19日のマネタリーベース>

5,644,000

<3月23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	4,509,500
前日の日銀当座預金残高-①	4,431,800
日銀当座預金残高増減前日比	+77,700

<3月23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	+200
財政等要因	+78,800
資金過不足	+79,000
金融調節	
社債等買入	-100
国債補完供給	+3,100
金融調節合計	-3,700
当座預金増減-②	+75,300

<3月23日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,507,100
準備預金残高	4,146,800
積み終了先	4,141,300
超過準備	4,140,600
非準備先残高	360,300

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,128,900
今積み期間所要準備額(平均)	133,200
残り要積立額(積数)	21,000
残り要積立額(平均)	900
準備進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	25.8
進捗率乖離幅	+73.6

<3月24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	-200
資金過不足	+400
金融調節確定分	
社債等買入	-100
国債補完供給	+6,700
金融調節合計	+6,600
当座預金増減	+7,000

<3月24日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残451兆4,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。

<3月24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	4,559,100	+52,000
+40,000	4,554,100	+47,000
+35,000	4,549,100	+42,000
+30,000	4,544,100	+37,000
+25,000	4,539,100	+32,000
+20,000	4,534,100	+27,000
+15,000	4,529,100	+22,000
+10,000	4,524,100	+17,000
+5,000	4,519,100	+12,000
±0	4,514,100	+7,000
-5,000	4,509,100	+2,000
-10,000	4,504,100	-3,000
-15,000	4,499,100	-8,000
-20,000	4,494,100	-13,000
-25,000	4,489,100	-18,000
-30,000	4,484,100	-23,000
-35,000	4,479,100	-28,000
-40,000	4,474,100	-33,000
-45,000	4,469,100	-38,000

<3月23日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	26/ 3/23-26/ 3/24	応札 7,457億 落札 7,457億 全取 +0.550% 平均 +0.550%
(13:50) 国債補完供給	26/ 3/23-26/ 3/24	応札 95億 落札 95億 全取 +0.550% 平均 +0.550%

<3月23日 各オペ残高と内訳>

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	
8,011	22,631	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	130			
3/18~ 4/ 1	8,011.	3/17(1-3Y) 2,701.	3,160	523,095	5/12~ 5/12	0.	
		3/17(3-5Y) 2,455.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 70,188.	8/18~ 8/18	130.	
		3/17(5-10Y) 2,600.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/20~ 6/19 46,265.	11/17~11/17	0.	
		3/17(25Y-) 753.		9/14~ 9/14 30,590.	2/16~ 2/16	0.	
				9/12~ 9/14 10,693.			
				12/14~12/14 36,712.			
				12/15~12/14 5,876.			
				3/17~ 3/17 78,260.			
				6/19~ 6/18 59,459.			
共通担保(全店)金利入札		※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			
70,035		成長基盤強化支援米ドル特別	米ドル資金供給オペ	0百万ドル		気候変動対応支援資金供給	
1/24~ 1/24 10,003.		2,384百万ドル	0百万ドル			211,146	
2/ 1~ 2/ 1 10,004.		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	3/19~ 3/26 0.			7/18~ 7/21 101,594.	
2/15~ 2/15 10,004.						1/30~ 2/ 1 109,552.	
3/ 1~ 3/ 1 10,010.							
9/15~ 9/15 10,005.							
10/10~10/10 10,006.							
10/25~10/25 10,003.							
国債補完供給		※直近約1週間の実施分を記載					
7,552		国債買入額(固定利回)(月初末)	0				
3/23~ 3/24 7,457.							
3/23~ 3/24 95.							
ETF買入額		C P買入額(月初末)					
356,921		0					
約定 23/10/ 4 701.							
ETF買入額(企業支援)		社債買入額(月初末)					
14,628		0					
約定 21/ 3/31 12.							
J-REIT買入額		国債売現先(米ドルオペ用担保)					
6,823		0					
約定 22/ 6/14 12.							
		※直近約1週間の実施分を記載					
		国債売現先オペ					
		0					
		国債短期証券買入額(月初末)					
		0					
		国債買現先オペ					
		0					
		国債売現先(米ドルオペ用担保)					
		0					
		C P買入額(月初末)					
		0					
		社債買入額(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					

<3月23日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	8,011	CP等買入(推定)	0
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	22,200
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	130		
気候変動対応支援	211,146		
成長基盤支援	2,556	手形売出	0
貸出増加支援	477,746	国債売現先	0
供給オペ合計	769,624	国債補完供給	7,552
貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
供給額合計	769,624	吸収額合計	7,552
	差し引き		762,072

※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。

<3月23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	+1.155000	3M	買気配
1W	+0.650	2M	-----	6M	+0.950
2W	+0.650	3M	-----	1Y	+1.100
1M	+0.650				

<3月19日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,333	-2,691
有担保	26,528	+309
無担保	88,805	-3,000

<3月23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	0.700	0.850	0.727	-0.001			0.680	±0	0.752	+0.003
トムネ				-----				-----	0.754	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.780	0.810	0.784	-0.029				-----	0.749	-0.001
2週間物				-----				-----	0.749	-0.001
3週間物				-----				-----	0.749	-0.001
1ヶ月物				-----				-----	0.749	-0.001
3ヶ月物			1.100	-----				-----	0.837	+0.005
6ヶ月物				-----				-----	0.894	+0.007
1年物				-----				-----	1.009	+0.004

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