

東京短資デイリーレポート

2023/1/5

<1月4日のマナリーベース>

6,314,100

<1月5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	5,064,100
前日の日銀当座預金残高①	5,017,400
日銀当座預金残高増減前日比	+46,700

<1月5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		+2,900
財政等要因		+5,900
資金過不足		+8,800
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+6,100
共通担保(全店)		+10,000
国債補完供給	+33,100	-31,000
金融調節合計		+18,200
当座預金増減②		+27,000

<1月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,044,400
準備預金残高	4,394,200
積み終了先	4,394,100
超過準備	4,394,100
非準備先残高	650,200

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,904,800
今積み期間所要準備額(平均)	126,000
残り要積立額(積数)	600
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	67.7
進捗率乖離幅	+32.2

<1月6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		+3,100
財政等要因		-62,400
資金過不足		-59,300
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)		+20,000
CP等買入		-100
国債補完供給	+31,000	
金融調節合計		+50,900
当座預金増減		-8,400

<1月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残503兆6,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.050%~-0.025% での合いが中心か。

<1月6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	5,081,000	+36,600
+40,000	5,076,000	+31,600
+35,000	5,071,000	+26,600
+30,000	5,066,000	+21,600
+25,000	5,061,000	+16,600
+20,000	5,056,000	+11,600
+15,000	5,051,000	+6,600
+10,000	5,046,000	+1,600
+5,000	5,041,000	-3,400
±0	5,036,000	-8,400
-5,000	5,031,000	-13,400
-10,000	5,026,000	-18,400
-15,000	5,021,000	-23,400
-20,000	5,016,000	-28,400
-25,000	5,011,000	-33,400
-30,000	5,006,000	-38,400
-35,000	5,001,000	-43,400
-40,000	4,996,000	-48,400
-45,000	4,991,000	-53,400

<1月5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(国)(5Y-10Y)	23/ 1/ 6	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.030%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 1/ 6	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.026%
(11:50) 国債補完供給	23/ 1/ 5-23/ 1/ 6	応札	31,477億	落札	31,477億	全取	-0.350% 平均 -0.350%
(13:00) 共通担保(全店)	23/ 1/ 6-25/ 1/ 6	20,000億	応札	51,717億	落札	20,014億	貸付 0.000% 按分 38.7%
(13:50) 国債補完供給	23/ 1/ 5-23/ 1/ 6	応札	0億	落札	0億		

<1月5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	14,676	国債買入額(月初来)	16,015	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	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
12/20~ 1/11	4,660.	12/29(1-3Y)	1,000.	55,060	682,240	2/19~ 2/17	0.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	12/29(3-5Y)	1,002.	3/ 4~ 3/ 3	2,859.	3/19~ 2/17	0.
(1/ 6~ 1/ 6	20,014.)	12/29(5-10Y)	3,003.	3/ 6~ 3/ 6	1.	6/19~ 6/19	2,033.
		12/30(1-3Y)	1,000.	6/ 4~ 6/ 2	4,312.	9/17~ 9/15	13,014.
		12/30(3-5Y)	1,001.	6/ 5~ 6/ 5	5.	12/16~12/15	20,601.
		12/30(5-10Y)	1,009.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.		
		12/30(5-10Y)	3,000.	9/ 4~ 9/ 4	34.		
		1/ 4(1-3Y)	3,002.	12/ 4~12/ 4	10,258.		
		1/ 4(3-5Y)	1,000.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.		
		1/ 4(5-10Y)	3,001.				
		1/ 4(10-25Y)	3,001.				
		1/ 5(1-3Y)	2,003.				
		1/ 5(3-5Y)	1,000.				
		1/ 5(5-10Y)	1,504.				
		1/ 5(10-25Y)	1,504.				
		国債売現先オペ	0				
		国債売現先(米ドルオペ用担保)	0				
		国債買入額(固定利回)(月初来)	0				
		12/29(1-3Y)	375.				
		12/29(3-5Y)	1,208.				
		12/30(1-3Y)	460.				
		12/30(3-5Y)	74.				
		国庫短期証券買入額(月初来)	0				
		ETF買入額	354,818				
		約定 22/12/ 2	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.				

※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5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	+0.010000	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	+0.014000	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	+0.038000	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

<1月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	159,725	+22,390
有担保	28,634	+3,519
無担保	131,091	+18,871

<1月5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	-0.080	0.001	-0.039	-0.001					-0.093	-0.002
トムネ									-0.095	+0.001
スポネ										
1週間物			-0.060	-0.026					-0.104	+0.001
2週間物	-0.050	-0.040	-0.045	-0.005					-0.112	+0.002
3週間物									-0.117	+0.001
1ヶ月物	-0.040	0.030	-0.028	±0					-0.124	±0
3ヶ月物									-0.129	+0.006
6ヶ月物									-0.114	+0.006
1年物									-0.099	+0.001

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