

東京短資デイリーレポート

2023/1/10

<1月6日のマナリーベース>

6,297,200

<1月10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	5,054,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,006,600
日銀当座預金残高増減前日比	+47,600

<1月10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		+2,800
財政等要因		-20,800
資金過不足		-18,000
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+24,100
共通担保(全店)		+20,000
CP等買入		-100
国債補完供給	+25,700	-36,700
金融調節合計		+33,000
当座預金増減-②		+15,000

<1月10日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,021,600
準備預金残高	4,391,100
積み終了先	4,391,000
超過準備	4,391,000
非準備先残高	630,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,901,400
今積み期間所要準備額(平均)	125,900
残り要積立額(積数)	200
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	83.9
進捗率乖離幅	+16.0

<1月11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		+2,700
財政等要因		+48,000
資金過不足		+50,700
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+2,600
共通担保(全店)	-4,700	+1,400
国債補完供給	+36,700	
金融調節合計		+36,000
当座預金増減		+86,700

<1月11日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残510兆8,300億円)で 無担保コール0/Nは-0.040%~-0.025% での合いが中心か。

<1月11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	5,153,300	+131,700
+40,000	5,148,300	+126,700
+35,000	5,143,300	+121,700
+30,000	5,138,300	+116,700
+25,000	5,133,300	+111,700
+20,000	5,128,300	+106,700
+15,000	5,123,300	+101,700
+10,000	5,118,300	+96,700
+5,000	5,113,300	+91,700
±0	5,108,300	+86,700
-5,000	5,103,300	+81,700
-10,000	5,098,300	+76,700
-15,000	5,093,300	+71,700
-20,000	5,088,300	+66,700
-25,000	5,083,300	+61,700
-30,000	5,078,300	+56,700
-35,000	5,073,300	+51,700
-40,000	5,068,300	+46,700
-45,000	5,063,300	+41,700

<1月10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/ 1/11	応札 2,628億 落札 2,628億	固定利回較差 0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 1/11	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.055%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 1/12-23/ 1/19	応札 0ml 落札 0ml	貸付 4.580%
(11:50) 国債補完供給	23/ 1/10-23/ 1/11	応札 37,110億 落札 37,110億	全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:00) 共通担保(全)国	23/ 1/11-23/ 1/25	応札 1,359億 落札 1,359億	貸付 0.000%
(13:50) 国債補完供給	23/ 1/10-23/ 1/11	応札 60億 落札 60億	全取 -0.350% 平均 -0.350%

<1月10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
54,701	34,277	成長基盤強化支援資金供給	2,638
12/20~ 1/11 4,660.	1/ 4(1-3Y) 3,002.	55,060	682,240
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	1/ 4(3-5Y) 1,000.	3/ 4~ 3/ 3 2,859.	3/18~ 3/17 37,714.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	1/ 4(5-10Y) 3,001.	3/ 6~ 3/ 6 1.	6/19~ 6/19 28,033.
1/10~ 1/10 20,011.	1/ 4(10-25Y) 3,001.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	9/17~ 9/15 13,014.
(1/11~ 1/25 1,359.)	1/ 5(1-3Y) 2,003.	6/ 5~ 6/ 5 5.	12/16~12/15 20,601.
国債買入先オペ	1/ 5(3-5Y) 1,000.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	※直近約1年分の期落ち分を記載
0	1/ 5(5-10Y) 1,504.	9/ 4~ 9/ 4 34.	11/19~11/17 0.
	1/ 5(10-25Y) 1,504.	12/ 4~12/ 4 10,258.	2/18~ 2/16 0.
	1/10(-1Y) 1,500.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	米ドル資金供給オペ
国債補完供給	1/10(1-3Y) 5,002.	※直近約1年分の期落ち分を記載	0百万ドル
37,170	1/10(3-5Y) 5,753.	成長基盤強化支援米ドル特別	12/29~ 1/12 0.
1/10~ 1/11 37,110.	1/10(5-10Y) 3,005.	17,925百万ドル	(1/12~ 1/19 0.)
1/10~ 1/11 60.	1/10(10-25Y) 3,002.	3/ 4~ 3/ 3 2,369.	8/19~ 8/19 381.
		6/ 3~ 6/ 2 5,848.	11/18~11/18 93.
		9/ 2~ 9/ 5 6,101.	
		12/ 2~12/ 4 3,607.	
国債売先オペ		0	
0			
国債売先(米ドルオペ用担保)	※直近約1週間の実施分を記載	7/29~ 1/27 5,973.	気候変動対応支援資金供給
0	国債買入額(固定利回)(月初来)	8/31~ 2/28 11,713.	36,436
	5,937	9/28~ 3/31 73,020.	
	1/10(5-10Y) 5,937.	10/27~ 1/27 2,095.	
	(1/11(5-10Y) 2,628.)	11/30~ 2/28 2,788.	
		12/23~ 3/31 8,358.	
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.	※直近約1週間の実施分を記載		

※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10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 -----	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M +0.002000	6M 買気配 -0.100
2W 売気配 -0.020	3M +0.052000	1Y 買気配 -0.030
1M 売気配 -0.020		

<1月6日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	191,025	+22,572
有担保	31,508	+2,844
無担保	159,517	+19,728

<1月10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	-0.027	-0.012				-----	-0.092	-0.001
トムネ				-----				-----	-0.100	-0.005
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.035	-0.023	-0.029	-----				-----	-0.107	-0.004
2週間物	-0.055	-0.025	-0.046	-----				-----	-0.114	-0.003
3週間物				-----				-----	-0.119	-0.005
1ヶ月物				-----				-----	-0.126	-0.003
3ヶ月物	0.001	0.030	0.014	-----				-----	-0.127	±0
6ヶ月物				-----				-----	-0.110	-0.002
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