

東京短資デイリーレポート

2023/1/19

<1月18日のマネタリーベース>

6,399,500

<1月19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	5,212,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,123,400
日銀当座預金残高増減前日比	+89,400

<1月19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	+500
財政等要因	+2,300
資金過不足	+2,800
金融調節	
国債買入	+700
共通担保(全店)	+1,200
国債補充供給	+82,800
金融調節合計	+400
当座預金増減-②	+3,200

<1月19日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,126,600
準備預金残高	4,469,100
積み終了先	4,459,900
超過準備	4,454,000
非準備先残高	657,500

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,910,200
今積み期間所要準備額 (平均)	126,100
残り要積立額 (積数)	38,500
残り要積立額 (平均)	1,400
準備進捗率(%)	99.0
日数進捗率(%)	12.9
進捗率乖離幅	+86.1

<1月20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	+1,000
財政等要因	-24,700
資金過不足	-23,700
金融調節確定分	
CP等買入	-600
国債補充供給	+84,300
金融調節合計	+83,700
当座預金増減	+60,000

<1月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残518兆6,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<1月20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	5,231,600	+105,000
+40,000	5,226,600	+100,000
+35,000	5,221,600	+95,000
+30,000	5,216,600	+90,000
+25,000	5,211,600	+85,000
+20,000	5,206,600	+80,000
+15,000	5,201,600	+75,000
+10,000	5,196,600	+70,000
+5,000	5,191,600	+65,000
± 0	5,186,600	+60,000
-5,000	5,181,600	+55,000
-10,000	5,176,600	+50,000
-15,000	5,171,600	+45,000
-20,000	5,166,600	+40,000
-25,000	5,161,600	+35,000
-30,000	5,156,600	+30,000
-35,000	5,151,600	+25,000
-40,000	5,146,600	+20,000
-45,000	5,141,600	+15,000

<1月19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/ 1/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.085%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y) 23/ 1/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.095%
(10:40) 社債買入 23/ 1/24	1,000億	応札	1,840億	落札	1,000億	最低 +0.252% 平均 +0.280% 按分 44.3%
(11:50) 国債補充供給 23/ 1/19-23/ 1/20	応札	84,595億	落札	84,595億	全取	-0.350% 平均 -0.395%
(13:50) 国債補充供給 23/ 1/19-23/ 1/20	応札	607億	落札	607億	全取	-0.350% 平均 -0.350%

<1月19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	
9,2580	91,865	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	2,638
1/5~1/6 10,016.	1/12(1-3Y) 1,001.	55,060	682,240	2/19~2/17 0.
1/6~1/6 20,014.	1/12(3-5Y) 1,001.	3/4~3/3 2,859.	3/18~3/17 37,714.	3/19~2/17 0.
1/10~1/10 20,011.	1/12(5-10Y) 3,010.	3/6~3/6 1.	6/19~6/19 28,033.	4/16~2/17 1,268.
1/11~1/25 1,359.	1/12(10-25Y) 2,002.	6/4~6/2 4,312.	9/17~9/15 13,014.	5/14~5/12 300.
1/13~1/14 20,008.	1/12(25Y-) 502.	6/5~6/5 5.	12/16~12/15 20,601.	6/11~5/12 596.
1/16~1/16 20,009.	1/13(1-3Y) 5,004.	9/3~9/1 1,940.		8/20~8/18 0.
1/19~1/20 1,163.	1/13(5-10Y) 7,752.	9/4~9/4 34.		11/19~11/17 0.
	1/13(10-25Y) 3,002.	12/4~12/4 10,258.	米ドル資金供給オペ	2/18~2/16 0.
	1/13(25Y-) 2,002.	3/4~3/4 2,178.	3百万ドル	5/17~5/17 0.
	1/13(変国) 300.		1/19~1/26 3.	8/19~8/19 381.
	1/16(1-3Y) 1,001.			11/18~11/18 93.
	1/16(3-5Y) 5,002.			
	1/16(5-10Y) 5,002.			
	1/16(10-25Y) 3,002.			
1/19~1/20 84,595.	1/16(3-5Y) 1,001.			
1/19~1/20 607.	1/16(5-10Y) 2,000.			
	1/16(10-25Y) 1,001.			
	1/17(1-3Y) 1,000.			
	1/17(3-5Y) 5,002.			
	1/17(5-10Y) 5,000.			
	1/17(10-25Y) 3,001.			
	国債買入額(固定利回)(月初末)			
	9,0213			
	1/12(5-10Y) 4,680.			
	1/13(5-10Y) 25,084.			
	1/13(5-10Y) 3,000.			
	1/16(5-10Y) 12,511.			
	1/16(5-10Y) 19,563.			
	1/17(5-10Y) 2,149.			
	1/17(5-10Y) 4,996.			
	1/18(5-10Y) 4,288.			
	1/18(5-10Y) 4,677.			
	1/19(5-10Y) 320.			
	1/19(5-10Y) 380.			
	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19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 +0.080000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M +0.004000	6M 買気配 -0.100
2W 売気配 -0.020	3M +0.044000	1Y 買気配 -0.100
1M 売気配 -0.020		

<1月18日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	203,097	+2,839
有担保	27,819	-2,465
無担保	175,278	+5,304

<1月19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	-0.070	0.001	-0.010	+0.001					-0.096	+0.002
トムネ									-0.111	+0.011
スポネ			-0.005	± 0						
1週間物	-0.020	0.008	-0.014	± 0					-0.124	+0.005
2週間物	-0.030	-0.003	-0.016	+0.001					-0.134	+0.003
3週間物									-0.139	+0.002
1ヶ月物	-0.020	0.020	0.002						-0.142	+0.001
3ヶ月物	0.025	0.480	0.066						-0.139	-0.003
6ヶ月物									-0.103	± 0
1年物									-0.081	± 0

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い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