東京短資デイリーレポート　2023/1/26

<1月25日のマネタリーベース>

6,451,100

<1月26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	5,290,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,178,700
日銀当座預金残高増減前日比	+111,600

<1月26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		-400
財政等要因		+17,900
資金過不足		+17,500
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+19,400
CP等買入	-200	
社債等買入	-400	
国債補完供給	+74,200	-77,100
金融調節合計		+15,900
当座預金増減-②		+33,400

<1月26日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,212,100
準備預金残高	4,546,200
積み終了先	4,544,500
超過準備	4,544,400
非準預先残高	665,900

<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）	13,000
残り要積立額（平均）	700
準預進捗率(%)	99.6
日数進捗率(%)	35.5
進捗率乖離幅	+64.1

<1月27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		+500
財政等要因		-4,100
資金過不足		-3,600
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-500	
新型コロナ対応金融	-8,100	+2,500
国債補完供給	+77,100	
金融調節合計		+71,000
当座預金増減		+67,400

<1月27日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残527兆9,500億円)で
無担保コール0/Nは-0.020%～-0.010%
での出合いが中心か。

<1月27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	5,324,500	+112,400
+40,000	5,319,500	+107,400
+35,000	5,314,500	+102,400
+30,000	5,309,500	+97,400
+25,000	5,304,500	+92,400
+20,000	5,299,500	+87,400
+15,000	5,294,500	+82,400
+10,000	5,289,500	+77,400
+5,000	5,284,500	+72,400
± 0	5,279,500	+67,400
-5,000	5,274,500	+62,400
-10,000	5,269,500	+57,400
-15,000	5,264,500	+52,400
-20,000	5,259,500	+47,400
-25,000	5,254,500	+42,400
-30,000	5,249,500	+37,400
-35,000	5,244,500	+32,400
-40,000	5,239,500	+27,400
-45,000	5,234,500	+22,400

<1月26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(固)(5Y-10Y)	23/ 1/27	応札	0億	落札	0億	固定利回較差 +0.065%
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 1/27	応札	0億	落札	0億	固定利回較差 +0.187%
(11:50)	国債補完供給	23/ 1/26-23/ 1/27	応札	77,315億	落札	77,315億	全取 -0.350% 平均 -0.360%
(13:50)	国債補完供給	23/ 1/26-23/ 1/27	応札	7億	落札	7億	全取 -0.350% 平均 -0.350%
(9:30)	新型コロナ企業金融支援	23/ 1/27-23/ 4/27	応札	2,514億	落札	2,514億	貸付 0.000%

<1月26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

９６,９９１

1/ 5~ 1/ 6	10,016.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.
1/10~ 1/10	20,011.
1/13~ 1/14	20,008.
1/16~ 1/16	20,009.
1/19~ 1/20	1,163.
1/25~ 2/ 8	5,770.

国債補完供給

７７,３２２

1/26~ 1/27	77,315.
1/26~ 1/27	7.

国債売現先(米ドルオペ用担保)

０

国庫短期証券買入額(月初来)

３,０００

1/13	1,000.
1/18	1,000.
1/25	1,000.

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.

国債買入額(月初来)

１２９,１５２

1/23(1-3Y)	5,003.
1/23(3-5Y)	5,753.
1/23(5-10Y)	5,754.
1/23(25Y-)	2,009.
1/26(1-3Y)	5,002.
1/26(3-5Y)	5,005.
1/26(5-10Y)	5,757.
1/26(10-25Y)	3,004.

※直近約1週間の実施分を記載

国債買入額(固定利回)(月初来)

９０,２１３

1/19(5-10Y)	320.
1/19(5-10Y)	380.

※直近約1週間の実施分を記載

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

５５,０６０

3/ 4~ 3/ 3	2,859.
3/ 6~ 3/ 6	1.
6/ 4~ 6/ 2	4,312.
6/ 5~ 6/ 5	5.
9/ 3~ 9/ 1	1,940.
9/ 4~ 9/ 4	34.
12/ 4~12/ 4	10,258.
3/ 4~ 3/ 4	2,178.

※直近約1年分の期落ち分を記載

成長基盤強化支援米ドル特則

１７,９２５百万ﾄﾞﾙ

3/ 4~ 3/ 3	2,369.
6/ 3~ 6/ 2	5,848.
9/ 2~ 9/ 5	6,101.
12/ 2~12/ 4	3,607.

国債買現先オペ

０

国債売現先オペ

０

ＣＰ買入額(月初来)

３,９９０

1/16	3,990.
(1/30	3,980.)

社債買入額(月初来)

１,０００

1/24	1,000.

貸出増加支援資金供給

６８２,２４０

3/18~ 3/17	37,714.
6/19~ 6/19	28,033.
9/17~ 9/15	13,014.
12/16~12/15	20,601.

※直近約1年分の期落ち分を記載

米ドル資金供給オペ

１百万ﾄﾞﾙ

1/26~ 2/ 2	1.

新型コロナ企業金融支援

１０３,９４７

7/29~ 1/27	5,973.
8/31~ 2/28	11,713.
9/28~ 3/31	73,020.
10/27~ 1/27	2,095.
11/30~ 2/28	2,788.
12/23~ 3/31	8,358.
(1/27~ 4/27	2,514.)

被災地金融機関支援資金供給

２,６３８

2/19~ 2/17	0.
3/19~ 2/17	0.
4/16~ 2/17	1,268.
5/14~ 5/12	300.
6/11~ 5/12	596.
8/20~ 8/18	0.
11/19~11/17	0.
2/18~ 2/16	0.
5/17~ 5/17	0.
8/19~ 8/19	381.
11/18~11/18	93.

気候変動対応支援資金供給

３６,４３６

12/24~ 1/30	20,483.
7/21~ 7/21	15,953.

<1月26日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	96,991	CP等買入(推定)	26,300
国債買現先	0	社債等買入(推定)	81,900
被災地金融機関支援	2,638		
気候変動対応支援	36,436		
成長基盤支援	50,442		
貸出増加支援	608,567	手形売出	0
新型コロナ企業金融支援	103,947	国債売現先	0
供給オペ合計	899,021	国債補完供給	77,322
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	899,021	吸収額合計	77,322
		差し引き	821,699

※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26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	+0.025000	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	+0.005000	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	+0.010000	1Y	買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020				

<1月25日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	199,873	-4,040
有担保	28,864	-184
無担保	171,009	-3,856

<1月26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	-0.073	0.001	-0.014	± 0				------	-0.092	+0.001
トムネ				------				------	-0.097	± 0
スポネ			-0.005	± 0				------		
1週間物			0.008	+0.028				------	-0.113	+0.001
2週間物	-0.015	-0.001	-0.002	+0.026				------	-0.124	+0.002
3週間物				------				------	-0.138	+0.003
1ヶ月物			-0.020	------				------	-0.143	+0.001
3ヶ月物				------				------	-0.143	± 0
6ヶ月物				------				------	-0.106	± 0
1年物				------				------	-0.081	+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