

東京短資デイリーレポート

2023/1/30

<1月27日のマナリーベース>

6,475,200

<1月30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	5,301,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,202,800
日銀当座預金残高増減前日比	+99,000

<1月30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		+11,100
資金過不足		+11,600
金融調節		
CP等買入	-1,000	+4,000
気候変動対応支援	-20,500	+28,300
国債補完供給	+77,600	-76,800
金融調節合計		+11,600
当座預金増減-②		+23,200

<1月30日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,226,000
準備預金残高	4,556,700
積み終了先	4,555,800
超過準備	4,555,800
非準備先残高	669,300

<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)	5,600
残り要積立額 (平均)	400
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	48.4
進捗率乖離幅	+51.4

<1月31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		+400
財政等要因		+10,100
資金過不足		+10,500
金融調節確定分		
国債買入		+18,400
CP等買入	-2,500	
国債補完供給	+76,800	
金融調節合計		+92,700
当座預金増減		+103,200

<1月31日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残532兆9,200億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.010% での合いが中心か。

<1月31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	5,374,200	+148,200
+40,000	5,369,200	+143,200
+35,000	5,364,200	+138,200
+30,000	5,359,200	+133,200
+25,000	5,354,200	+128,200
+20,000	5,349,200	+123,200
+15,000	5,344,200	+118,200
+10,000	5,339,200	+113,200
+5,000	5,334,200	+108,200
± 0	5,329,200	+103,200
-5,000	5,324,200	+98,200
-10,000	5,319,200	+93,200
-15,000	5,314,200	+88,200
-20,000	5,309,200	+83,200
-25,000	5,304,200	+78,200
-30,000	5,299,200	+73,200
-35,000	5,294,200	+68,200
-40,000	5,289,200	+63,200
-45,000	5,284,200	+58,200

<1月30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(3Y-5Y)	23/ 1/31	5,000億	応札 6,984億	落札 5,001億	最低 -0.016%	平均 -0.009%	按分 5.5%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 1/31	6,750億	応札 12,139億	落札 6,753億	最低 -0.014%	平均 -0.009%	按分 20.9%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 1/31	4,000億	応札 8,165億	落札 4,009億	最低 -0.019%	平均 -0.016%	按分 22.5%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/ 1/31	2,000億	応札 3,776億	落札 2,011億	最低 +0.006%	平均 +0.008%	按分 33.2%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 1/31		応札 0億	落札 0億	固定利回差	+0.025%	
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 1/31		応札 0億	落札 0億	固定利回差	+0.131%	
(10:10) 国債買入(物国)	23/ 1/31	600億	応札 2,568億	落札 601億	按分 -0.450円	平均 -0.549円	按分 77.1%
(11:50) 国債補完供給	23/ 1/30-23/ 1/31		応札 77,160億	落札 77,160億	全取 -0.350%	平均 -0.358%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 1/30-23/ 1/31		応札 107億	落札 107億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	

<1月30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)固定金利	国債買入額(月初末)	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
9,6,9,9,1	1,2,9,1,5,2			2,6,3,8
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	1/23(1-3Y) 5,003.	5,5,0,6,0	6,8,2,2,4,0	2/19~ 2/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	1/23(3-5Y) 5,753.	3/ 4~ 3/ 3 2,859.	3/18~ 3/17 37,714.	3/19~ 2/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	1/23(5-10Y) 5,754.	3/ 6~ 3/ 6 1.	6/19~ 6/19 28,033.	4/16~ 2/17 1,268.
1/13~ 1/14 20,008.	1/23(25Y-) 2,009.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	9/17~ 9/15 13,014.	5/14~ 5/12 300.
1/16~ 1/16 20,009.	1/26(1-3Y) 5,002.	6/ 5~ 6/ 5 5.	12/16~12/15 20,601.	6/11~ 5/12 596.
1/19~ 1/20 1,163.	1/26(3-5Y) 5,005.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.		8/20~ 8/18 0.
1/25~ 2/ 8 5,770.	1/26(5-10Y) 5,757.	9/ 4~ 9/ 4 34.		11/19~11/17 0.
	1/26(10-25Y) 3,004.	12/ 4~12/ 4 10,258.		2/18~ 2/16 0.
	(1/31(3-5Y) 5,001.)	3/ 4~ 3/ 4 2,178.		5/17~ 5/17 0.
	(1/31(5-10Y) 6,753.)			8/19~ 8/19 381.
	(1/31(10-25Y) 4,009.)			11/18~11/18 93.
	(1/31(25Y-) 2,011.)			
	(1/31(物国) 601.)			
国債補完供給	7,7,2,6,7			
1/30~ 1/31 77,160.				
1/30~ 1/31 107.				
国債売現先(米ドルオペ用担保)	0			
※直近約1週間の実施分を記載				
国債買入額(固定利回)(月初末)	9,0,2,1,3			
国庫短期証券買入額(月初末)	3,0,0,0			
1/13 1,000.				
1/18 1,000.				
1/25 1,000.				
ETF買入額	3,5,4,8,1,8			
約定 22/12/ 2 701.				
ETF買入額(企業支援)	1,4,6,2,8			
約定 21/ 3/31 12.				
J-REIT買入額	6,8,2,3			
約定 22/ 6/14 12.				
※直近約1週間の実施分を記載				
国債買入額(月初末)	7,9,7,0			
1/16 3,990.				
1/30 3,980.				
CP買入額(月初末)	7,9,7,0			
1/16 3,990.				
1/30 3,980.				
社債買入額(月初末)	1,0,0,0			
1/24 1,000.				
国債買入先	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	44,214			
成長基盤強化支援	50,442			
貸出増加支援	608,567	手形売出	0	
新型コロナウイルス企業金融支援	98,393	国債売現先	0	
供給オペ合計	901,245	国債補完供給	77,267	
貸出(推定)	0	国債売現先	0	
供給額合計	901,245	吸収額合計	77,267	
差し引き			823,978	

※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30日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	1M	3M	1M	3M	1Y	3M
0.000						
1W 売気配 -0.020						
2W 売気配 -0.020						
1M 売気配 -0.020						

<1月27日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	202,358	-3,443
有担保	30,165	-2,083
無担保	172,193	-1,360

<1月30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	-0.014	± 0					-0.092	± 0
トムネ									-0.097	± 0
スポネ			-0.005	± 0						
1週間物									-0.115	-0.002
2週間物	-0.020	-0.010	-0.015	+0.013					-0.125	+0.002
3週間物									-0.136	+0.001
1ヶ月物									-0.142	+0.002
3ヶ月物									-0.142	+0.001
6ヶ月物									-0.103	+0.003
1年物									-0.080	+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