

# 東京短資デイリーレポート

2023/2/8

## <2月7日のマナリーベース>

6,415,600
-----------

## <2月8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	5,192,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,147,900
日銀当座預金残高増減前日比	+44,400

## <2月8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		-7,300
資金過不足		-6,800
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+100
国庫短期証券買入		+1,000
共通担保(全店)	-5,800	+2,800
CP等買入	-100	
国債補充供給	+53,500	-54,200
金融調節合計		-2,700
当座預金増減-②		-9,500

## <2月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,138,400
準備預金残高	4,476,700
積み終了先	4,476,600
超過準備	4,476,600
非準備先残高	661,700

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,906,000
今積み期間所要準備額(平均)	126,000
残り要積立額(積数)	300
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	77.4
進捗率乖離幅	+22.5

## <2月9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		+300
財政等要因		-100
資金過不足		+200
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+19,200
国債補充供給	+54,200	
金融調節合計		+73,400
当座預金増減		+73,600

## <2月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残521兆2,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.040%~-0.020% での出合いが中心か。
--

## <2月9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	5,257,000	+118,600
+40,000	5,252,000	+113,600
+35,000	5,247,000	+108,600
+30,000	5,242,000	+103,600
+25,000	5,237,000	+98,600
+20,000	5,232,000	+93,600
+15,000	5,227,000	+88,600
+10,000	5,222,000	+83,600
+5,000	5,217,000	+78,600
±0	5,212,000	+73,600
-5,000	5,207,000	+68,600
-10,000	5,202,000	+63,600
-15,000	5,197,000	+58,600
-20,000	5,192,000	+53,600
-25,000	5,187,000	+48,600
-30,000	5,182,000	+43,600
-35,000	5,177,000	+38,600
-40,000	5,172,000	+33,600
-45,000	5,167,000	+28,600

## <2月8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(1Y-3Y)	23/ 2/ 9	4,250億	応札 9,235億	落札 4,256億	最低 -0.007%	平均 -0.006%	按分 95.7%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 2/ 9	5,000億	応札 9,413億	落札 5,008億	最低 -0.005%	平均 -0.004%	按分 85.0%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/ 2/ 9	6,750億	応札 13,762億	落札 6,758億	最低 -0.004%	平均 -0.003%	按分 99.1%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 2/ 9	3,000億	応札 4,830億	落札 3,005億	最低 -0.009%	平均 -0.005%	按分 8.8%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 2/ 9		応札 105億	落札 105億	固定利回差差	+0.010%	
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 2/ 9		応札 0億	落札 0億	固定利回差差	+0.115%	
(10:40) CP買入	23/ 2/ 13	4,000億	応札 7,065億	落札 3,965億	最低 +0.003%	平均 +0.006%	按分 90.8%
(11:50) 国債補充供給	23/ 2/ 8-23/ 2/ 9		応札 53,445億	落札 53,445億	全取 -0.350%	平均 -0.351%	
(13:50) 国債補充供給	23/ 2/ 8-23/ 2/ 9		応札 1,067億	落札 1,067億	全取 -0.350%	平均 -0.350%	

## <2月8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	
93,992	15,764	成長基盤強化支援資金供給	2,638	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/ 6(-1Y) 1,502.	55,060	682,240	2/19~ 2/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/ 6(1-3Y) 4,252.	3/ 4~ 3/ 3 2,859.	3/18~ 3/17 37,714.	3/19~ 2/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	2/ 6(3-5Y) 5,003.	3/ 6~ 3/ 6 1.	6/19~ 6/19 28,033.	4/16~ 2/17 1,268.
1/13~ 1/14 20,008.	2/ 6(10-25Y) 3,004.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	9/17~ 9/15 13,014.	5/14~ 5/12 300.
1/16~ 1/16 20,009.	2/ 6(25Y-) 2,003.	6/ 5~ 6/ 5 5.	12/16~12/15 20,601.	6/11~ 5/12 596.
1/19~ 1/20 1,163.	(2/ 9(1-3Y) 4,256.)	9/ 3~ 9/ 1 1,940.		8/20~ 8/18 0.
2/ 8~ 2/22 2,771.	(2/ 9(3-5Y) 5,008.)	9/ 4~ 9/ 4 34.		11/19~11/17 0.
	(2/ 9(5-10Y) 6,758.)	12/ 4~12/ 4 10,258.		2/18~ 2/16 0.
	(2/ 9(10-25Y) 3,005.)	3/ 4~ 3/ 4 2,178.		5/17~ 5/17 0.
				8/19~ 8/19 381.
				11/18~11/18 93.
				米ドル資金供給オペ
				1百万ドル
				2/ 2~ 2/ 9 1.
				8/19~ 8/19 381.
				(2/ 9~ 2/16 2.)
				11/18~11/18 93.
				※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別
				17,925百万ドル
				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
				国債買入額(月初末)
				0
				(2/13 3,965.)
				社債買入額(月初末)
				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。

## <2月8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 +0.012000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.100
2W 売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.030
1M 売気配 -0.020		

## <2月7日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	178,643	-3,139
有担保	26,755	-2,204
無担保	151,888	-935

## <2月8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	-0.035	-0.006				-----	-0.101	±0
トムネ			-0.008	-0.002				-----	-0.107	±0
スポネ			-0.010	-0.005				-----		
1週間物	-0.025	-0.001	-0.006	-0.007				-----	-0.116	±0
2週間物	-0.035	-0.030	-0.034	-0.003				-----	-0.127	-0.001
3週間物			-0.030	-----				-----	-0.139	-0.002
1ヶ月物			-0.008	-----				-----	-0.147	-0.003
3ヶ月物				-----				-----	-0.146	±0
6ヶ月物				-----				-----	-0.107	±0
1年物				-----				-----	-0.082	-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、オペ取引の最終決定は御自身の判断でなされる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