

東京短資テイリーレポート

2023/2/17

<2月16日のマネタリーベース>

6,526,900

<2月17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	5,297,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,260,300
日銀当座預金残高増減前日比	+37,500

<2月17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		0
財政等要因		-16,200
資金過不足		-16,200
金融調節		
国債買入	期落	新規
CP等買入	-300	
社債等買入	-100	
被災地金融機関支援	-1,300	+300
国債補完供給	+55,300	-53,900
金融調節合計		+300
当座預金増減-②		-15,900

<2月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,244,400
準備預金残高	4,576,100
積み終了先	4,570,600
超過準備	4,480,800
非準備先残高	668,300

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,518,100
今積み期間所要準備額(平均)	125,600
残り要積立額(積数)	29,500
残り要積立額(平均)	1,200
準備進捗率(%)	99.1
日数進捗率(%)	14.3
進捗率乖離幅	+84.8

<2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		-500
財政等要因		-17,700
資金過不足		-18,200
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-300	
国債補完供給	+53,900	
金融調節合計		+53,900
当座預金増減		+35,700

<2月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残528兆100億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<2月20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	5,325,100	+80,700
+40,000	5,320,100	+75,700
+35,000	5,315,100	+70,700
+30,000	5,310,100	+65,700
+25,000	5,305,100	+60,700
+20,000	5,300,100	+55,700
+15,000	5,295,100	+50,700
+10,000	5,290,100	+45,700
+5,000	5,285,100	+40,700
± 0	5,280,100	+35,700
-5,000	5,275,100	+30,700
-10,000	5,270,100	+25,700
-15,000	5,265,100	+20,700
-20,000	5,260,100	+15,700
-25,000	5,255,100	+10,700
-30,000	5,250,100	+5,700
-35,000	5,245,100	+700
-40,000	5,240,100	-4,300
-45,000	5,235,100	-9,300

<2月17日 日銀オペ入札結果>

(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 2/20	応札 428億 落札 428億	固定利回較差 0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 2/20	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.095%
(11:50) 国債補完供給	23/ 2/17-23/ 2/20	応札 54,459億 落札 54,459億	全取 -0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 2/17-23/ 2/20	応札 0億 落札 0億	

<2月17日 各オペ残高と内訳>

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	
93,992	50,807	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1,716
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/16(1-3Y) 4,254.	55,060	682,240	5/14~ 5/12 300.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/16(5-10Y) 6,758.	3/ 4~ 3/ 3 2,859.	3/18~ 3/17 37,714.	6/11~ 5/12 596.
1/10~ 1/10 20,011.	2/16(10-25Y) 3,003.	3/ 6~ 3/ 6 1.	6/19~ 6/19 28,033.	8/20~ 8/18 0.
1/13~ 1/14 20,008.	2/16(25Y-) 2,001.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	9/17~ 9/15 13,014.	11/19~11/17 0.
1/16~ 1/16 20,009.		6/ 5~ 6/ 5 5.	12/16~12/15 20,601.	2/18~ 2/16 0.
1/19~ 1/20 1,163.		9/ 3~ 9/ 1 1,940.		5/17~ 5/17 0.
2/ 8~ 2/22 2,771.		9/ 4~ 9/ 4 34.		8/19~ 8/19 381.
		12/ 4~12/ 4 10,258.	米ドル資金供給オペ	11/18~11/18 93.
		3/ 4~ 3/ 4 2,178.	1百万ドル	2/17~ 2/17 346.

※直近約1年分の期落ち分を記載	2/16~ 2/24 1.
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.	
国債買入先オペ	0

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)(月初来)	
国庫短期証券買入額(月初来)	1,480
3,000	2/10(5-10Y) 280.
2/ 1 1,000.	2/13(5-10Y) 248.
2/ 8 1,000.	2/16(5-10Y) 54.
2/15 1,000.	2/17(5-10Y) 300.
(2/20(5-10Y) 428.)	
ETF買入額	3,965
354,818	2/13 3,965.
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.	

国債買入先	0
社債等買入(推定)	81,600
被災地金融機関支援	1,716
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	897,324
国債補完供給	54,459
貸出(推定)	0
国債売現先(米ドル担保)	0
供給額合計	897,324
吸収額合計	54,459
差し引き	842,865

※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17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 +0.010000	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 +0.015000	1Y 買気配 -0.030
1M	売気配 -0.020		

<2月16日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	190,542	+15,678
有担保	29,436	+302
無担保	161,106	+15,376

<2月17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	-0.065	0.001	-0.007	+0.003				-----	-0.083	+0.004
トムネ	-0.040	-0.010	-0.012	-0.002				-----	-0.083	+0.004
スポネ			-0.005	± 0				-----		
1週間物	-0.010	-0.005	-0.007	+0.018				-----	-0.101	+0.002
2週間物	-0.009	-0.007	-0.008	+0.006				-----	-0.111	+0.003
3週間物								-----	-0.119	+0.003
1ヶ月物			-0.008	+0.002				-----	-0.135	± 0
3ヶ月物								-----	-0.147	± 0
6ヶ月物								-----	-0.104	± 0
1年物								-----	-0.084	+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