

東京短資デイリーレポート

2023/3/3

<3月2日のマナリーベース>

6,455,700

<3月3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	5,231,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,185,200
日銀当座預金残高増減前日比	+46,000

<3月3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		+200
財政等要因		-30,700
資金過不足		-30,500
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+17,700
CP等買入	-200	
社債等買入	-800	
国債補完供給	+51,200	-52,100
成長基盤強化支援	-2,500	
金融調節合計		+13,300
当座預金増減-②		-17,200

<3月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,168,000
準備預金残高	4,515,700
積み終了先	4,515,500
超過準備	4,515,400
非準備先残高	652,300

<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)	800
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	64.3
進捗率乖離幅	+35.6

<3月6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		-3,000
資金過不足		-2,700
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+17,700
CP等買入	-200	
国債補完供給	+61,800	
金融調節合計		+79,300
当座預金増減		+76,600

<3月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残524兆4,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<3月6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	5,289,600	+121,600
+40,000	5,284,600	+116,600
+35,000	5,279,600	+111,600
+30,000	5,274,600	+106,600
+25,000	5,269,600	+101,600
+20,000	5,264,600	+96,600
+15,000	5,259,600	+91,600
+10,000	5,254,600	+86,600
+5,000	5,249,600	+81,600
±0	5,244,600	+76,600
-5,000	5,239,600	+71,600
-10,000	5,234,600	+66,600
-15,000	5,229,600	+61,600
-20,000	5,224,600	+56,600
-25,000	5,219,600	+51,600
-30,000	5,214,600	+46,600
-35,000	5,209,600	+41,600
-40,000	5,204,600	+36,600
-45,000	5,199,600	+31,600

<3月3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)	23/ 3/ 6	1,500億 応札 3,380億 落札 1,501億 最低 -0.015% 平均 -0.001% 按分 16.6%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	23/ 3/ 6	4,250億 応札 9,482億 落札 4,254億 最低 -0.003% 平均 -0.002% 按分 82.1%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	23/ 3/ 6	5,000億 応札 10,487億 落札 5,003億 最低 -0.004% 平均 -0.003% 按分 48.2%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	23/ 3/ 6	3,000億 応札 5,883億 落札 3,011億 最低 +0.002% 平均 +0.005% 按分 9.7%
(10:10) 国債買入(25Y-)	23/ 3/ 6	1,000億 応札 3,017億 落札 1,010億 最低 +0.013% 平均 +0.015% 按分 6.0%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 6	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.042%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 6	応札 2,776億 落札 2,776億 固定利回差 0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 6	応札 0億 落札 0億 固定利回差 +0.077%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/ 3-23/ 3/ 6	応札 18,242億 落札 16,681億 全取 -1.100% 平均 -3.540%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/ 3-23/ 3/ 6	応札 35,778億 落札 35,778億 全取 -0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/ 3/ 3-23/ 3/ 6	応札 11億 落札 11億 全取 -0.350% 平均 -0.350%

<3月3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)	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 5,511	0	成長基盤強化支援資金供給	1,716	
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/24(5-10Y) 3,004.	5 2,201	6 82,240	5/14~ 5/12 300.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/24(10-25Y) 1,004.	3/ 6~ 3/ 6 1.	3/18~ 3/17 37,714.	6/11~ 5/12 596.
1/10~ 1/10 20,011.	2/28(3-5Y) 5,003.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.	8/20~ 8/18 0.
1/13~ 1/14 20,008.	2/28(5-10Y) 6,755.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.	11/19~11/17 0.
1/16~ 1/16 20,009.	2/28(10-25Y) 3,006.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.	2/18~ 2/16 0.
1/19~ 1/20 1,163.	2/28(物国) 601.	9/ 4~ 9/ 4 34.		5/17~ 5/17 0.
2/22~ 3/ 8 4,290.	(3/ 6(-1Y) 1,501.)	12/ 4~12/ 4 10,258.		8/19~ 8/19 381.
	(3/ 6(1-3Y) 4,254.)	3/ 4~ 3/ 4 2,178.		11/18~11/18 93.
	(3/ 6(3-5Y) 5,003.)	6/ 3~ 6/ 3 1,950.		2/17~ 2/17 346.
	(3/ 6(10-25Y) 3,011.)			
	(3/ 6(25Y-) 1,010.)			
		※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		
		1 7,709百万ドル		
		6/ 3~ 6/ 2 5,848.		
		9/ 2~ 9/ 5 6,101.		
		12/ 2~12/ 4 3,607.		
		3/ 3~ 3/ 4 2,153.		
		国債買入先オペ		
		0		
		国債売入先オペ		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		ETF買入額		
		3 54,818		
		約定 22/12/ 2 701.		
		ETF買入額(企業支援)		
		1 4,628		
		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		
		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
		2		
		3/ 1~ 3/10 2.		
		※直近約1週間の実施分を記載		
		国庫短期証券買入額(月初末)		
		1 7,718		
		2/24(5-10Y) 1,413.		
		2/28(5-10Y) 174.		
		3/ 2(5-10Y) 20.		
		3/ 3(5-10Y) 17,698.		
		(3/ 6(5-10Y) 2,776.)		
		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		3/ 1~ 3/10 2.		
		※直近約1週間の実施分を記載		
		ETF買入額		
		3 54,818		
		約定 22/12/ 2 701.		
		ETF買入額(企業支援)		
		1 4,628		
		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。

<3月3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	-----	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				

<3月2日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	201,049	+382
有担保	29,220	-1,066
無担保	171,829	+1,448

<3月3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	-0.056	0.001	-0.010	+0.001	-----	-----	-----	-----	-0.086	-0.001
トムネ			-0.010	±0	-----	-----	-----	-----	-0.087	-0.001
スポネ			-0.008	±0	-----	-----	-----	-----		
1週間物				-----	-----	-----	-----	-----	-0.098	-0.001
2週間物	-0.010	-0.008	-0.009	+0.011	-----	-----	-----	-----	-0.105	-0.001
3週間物				-----	-----	-----	-----	-----	-0.117	-0.002
1ヶ月物				-----	-----	-----	-----	-----	-0.147	±0
3ヶ月物				-----	-----	-----	-----	-----	-0.146	±0
6ヶ月物				-----	-----	-----	-----	-----	-0.106	±0
1年物				-----	-----	-----	-----	-----	-0.083	±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、オペ取引の最終決定は御自身の判断でなされようをお願いいたします。
 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