

東京短資デイリーレポート

2023/3/6

<3月3日のマナリーベース>

6,438,300

<3月6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	5,244,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,168,000
日銀当座預金残高増減前日比	+76,600

<3月6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		+300
財政等要因		-300
資金過不足		± 0
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+17,700
CP等買入	-200	
国債補充供給	+49,500	-50,000
金融調節合計		+17,000
当座預金増減-②		+17,000

<3月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,185,000
準備預金残高	4,521,000
積み終了先	4,520,800
超過準備	4,520,800
非準備先残高	664,000

<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)	600
残り要積立額 (平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	67.9
進捗率乖離幅	+32.0

<3月7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		+3,700
資金過不足		+4,100
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+2,700
CP等買入	-100	
国債補充供給	+61,900	
金融調節合計		+64,500
当座預金増減		+68,600

<3月7日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残525兆3,600億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。

<3月7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	5,298,600	+113,600
+40,000	5,293,600	+108,600
+35,000	5,288,600	+103,600
+30,000	5,283,600	+98,600
+25,000	5,278,600	+93,600
+20,000	5,273,600	+88,600
+15,000	5,268,600	+83,600
+10,000	5,263,600	+78,600
+5,000	5,258,600	+73,600
± 0	5,253,600	+68,600
-5,000	5,248,600	+63,600
-10,000	5,243,600	+58,600
-15,000	5,238,600	+53,600
-20,000	5,233,600	+48,600
-25,000	5,228,600	+43,600
-30,000	5,223,600	+38,600
-35,000	5,218,600	+33,600
-40,000	5,213,600	+28,600
-45,000	5,208,600	+23,600

<3月6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(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 7	応札 2,650億 落札 2,650億	固定利回較差 0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 7	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.100%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 7	応札 0億 落札 0億	固定利回較差 +0.055%
(11:50) 国債補充供給	23/ 3/ 6-23/ 3/ 7	応札 13,223億 落札 13,223億 全取	-1.100% 平均 -4.005%
(11:50) 国債補充供給	23/ 3/ 6-23/ 3/ 7	応札 37,020億 落札 37,020億 全取	-0.350% 平均 -0.401%
(13:50) 国債補充供給	23/ 3/ 6-23/ 3/ 7	応札 61億 落札 61億 全取	-0.350% 平均 -0.350%

<3月6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
95,511	14,779	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
		17,709百万ドル	1,716
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/28(3-5Y) 5,003.	52,200	682,240
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/28(5-10Y) 6,755.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	3/18~ 3/17 37,714.
1/10~ 1/10 20,011.	2/28(10-25Y) 3,006.	6/ 5~ 6/ 5 5.	6/11~ 5/12 596.
1/13~ 1/14 20,008.	2/28(物国) 601.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	8/20~ 8/18 0.
1/16~ 1/16 20,009.	3/ 6(-1Y) 1,501.	9/ 4~ 9/ 4 34.	11/19~11/17 0.
1/19~ 1/20 1,163.	3/ 6(1-3Y) 4,254.	12/ 4~12/ 4 10,258.	2/18~ 2/16 0.
2/22~ 3/ 8 4,290.	3/ 6(3-5Y) 5,003.	6/ 4~ 3/ 4 2,178.	5/17~ 5/17 0.
	3/ 6(10-25Y) 3,011.	3/ 3~ 6/ 3 1,950.	8/19~ 8/19 381.
	3/ 6(25Y-) 1,010.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	11/18~11/18 93.
			2/17~ 2/17 346.
			2百万ドル
			3/ 2~ 3/ 9 2.
			※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
			17,709百万ドル
			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
			国債売現先オペ
			0
			国債買入額(月初来)
			0
			CP買入額(月初来)
			0
			社債買入額(月初来)
			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
			国債買入額(固定利回)(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			CP買入額(月初来)
			0
			社債買入額(月初来)
			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
			国債買入額(固定利回)(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000
			3/ 1 1,000.
			※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
			国債買入額(月初来)
			20,494
			2/28(5-10Y) 174.
			3/ 2(5-10Y) 20.
			3/ 3(5-10Y) 17,698.
			3/ 6(5-10Y) 2,776.
			(3/ 7(5-10Y) 2,650.)
			国庫短期証券買入額(月初来)
			1,000