東京短資デイリーレポート　2023/3/15

＜3月14日のマネタリーベース＞

6,495,800

＜3月15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	5,263,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,227,400
日銀当座預金残高増減前日比	+35,800

＜3月15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		-21,700
資金過不足		-21,200
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-400	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+43,200	-46,300
金融調節合計		-3,600
当座預金増減-②		-24,800

＜3月15日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高（①+②）	5,202,600
準備預金残高	4,594,600
積み終了先	4,594,600
超過準備	4,594,600
非準預先残高	608,000

＜参考＞

翌積み期間所要準備額（積数）	3,909,200
翌積み期間所要準備額（平均）	126,100

＜3月16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		+3,200
資金過不足		+2,900
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+15,600
CP等買入	-500	
国債補完供給	+57,800	
金融調節合計		+72,900
当座預金増減		+75,800

＜3月16日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残527兆8,400億円)で
無担保コール0/Nは-0.030%～-0.010%
での出合いが中心か。

＜3月16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	5,323,400	+120,800
+40,000	5,318,400	+115,800
+35,000	5,313,400	+110,800
+30,000	5,308,400	+105,800
+25,000	5,303,400	+100,800
+20,000	5,298,400	+95,800
+15,000	5,293,400	+90,800
+10,000	5,288,400	+85,800
+5,000	5,283,400	+80,800
± 0	5,278,400	+75,800
-5,000	5,273,400	+70,800
-10,000	5,268,400	+65,800
-15,000	5,263,400	+60,800
-20,000	5,258,400	+55,800
-25,000	5,253,400	+50,800
-30,000	5,248,400	+45,800
-35,000	5,243,400	+40,800
-40,000	5,238,400	+35,800
-45,000	5,233,400	+30,800

＜3月15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/ 3/16	4,250億	応札	4,987億	落札	4,250億	最低	-0.019%	平均	-0.009%	按分 46.1%
(10:10)	国債買入(3Y-5Y)	23/ 3/16	5,000億	応札	9,047億	落札	5,002億	最低	-0.008%	平均	-0.005%	按分 70.4%
(10:10)	国債買入(5Y-10Y)	23/ 3/16	5,750億	応札	14,342億	落札	5,754億	最低	-0.002%	平均	+0.005%	按分 17.9%
(10:10)	国債買入(25Y-)	23/ 3/16	500億	応札	2,350億	落札	503億	最低	+0.110%	平均	+0.116%	按分 22.6%
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 3/16		応札	0億	落札	0億		固定利回較差		+0.223%	
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 3/16		応札	0億	落札	0億		固定利回較差		+0.291%	
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 3/16		応札	0億	落札	0億		固定利回較差		+0.260%	
(11:50)	国債補完供給	23/ 3/15-23/ 3/16		応札	9,395億	落札	9,395億	全取	-1.100%	平均	-2.445%	
(11:50)	国債補完供給	23/ 3/15-23/ 3/16		応札	36,496億	落札	36,496億	全取	-0.350%	平均	-0.350%	
(13:50)	国債補完供給	23/ 3/15-23/ 3/16		応札	0億	落札	0億					
(13:50)	国債補完供給	23/ 3/15-23/ 3/16		応札	186億	落札	186億	全取	-0.350%	平均	-0.353%	
(9:30)	貸出増加支援	23/ 3/17-27/ 3/17	78,260億							貸付	0.000%	先数 78先

＜3月15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
97,681

1/ 5~ 1/ 6	10,016.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.
1/10~ 1/10	20,011.
1/13~ 1/14	20,008.
1/16~ 1/16	20,009.
1/19~ 1/20	1,163.
3/ 8~ 3/22	6,460.

国債買入額(月初来)
33,793

3/ 9(1-3Y)	4,254.
3/ 9(3-5Y)	5,005.
3/ 9(5-10Y)	6,755.
3/ 9(10-25Y)	3,000.
(3/16(1-3Y)	4,250.)
(3/16(3-5Y)	5,002.)
(3/16(5-10Y)	5,754.)
(3/16(25Y-)	503.)

貸出支援基金の運営として行うオペレーション

成長基盤強化支援資金供給
52,200

6/ 4~ 6/ 2	4,312.
6/ 5~ 6/ 5	5.
9/ 3~ 9/ 1	1,940.
9/ 4~ 9/ 4	34.
12/ 4~12/ 4	10,258.
3/ 4~ 3/ 4	2,178.
6/ 3~ 6/ 3	1,950.
9/ 2~ 9/ 2	1,804.

※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則
17,709百万ﾄﾞﾙ

6/ 3~ 6/ 2	5,848.
9/ 2~ 9/ 5	6,101.
12/ 2~12/ 4	3,607.
3/ 3~ 3/ 4	2,153.

貸出増加支援資金供給
682,240

3/18~ 3/17	37,714.
6/19~ 6/19	28,033.
9/17~ 9/15	13,014.
12/16~12/15	20,601.

※直近約1年分の期落ち分を記載

米ドル資金供給オペ
2百万ﾄﾞﾙ

3/ 9~ 3/16	2.
(3/16~ 3/24	1.)

被災地金融機関支援資金供給
1,716

5/14~ 5/12	300.
6/11~ 5/12	596.
8/20~ 8/18	0.
11/19~11/17	0.
2/18~ 2/16	0.
5/17~ 5/17	0.
8/19~ 8/19	381.
11/18~11/18	93.
2/17~ 2/17	346.

国債補完供給
46,077

3/15~ 3/16	9,395.
3/15~ 3/16	0.
3/15~ 3/16	36,496.
3/15~ 3/16	186.

国債買現先オペ
0

国債売現先(米ドルオペ用担保)
0

国債売現先オペ
0

※直近約1週間の実施分を記載

新型コロナ企業金融支援
89,247

9/28~ 3/31	73,020.
12/23~ 3/31	8,358.
1/27~ 4/27	2,514.
2/28~ 5/26	5,355.

国庫短期証券買入額(月初来)
3,000

3/ 1	1,000.
3/ 8	1,000.
3/14	1,000.

国債買入額(固定利回)(月初来)
34,409

3/ 8(5-10Y)	320.
3/ 9(5-10Y)	8,594.
3/10(5-10Y)	1,551.
3/13(5-10Y)	800.

※直近約1週間の実施分を記載

ＣＰ買入額(月初来)
3,980

3/13	3,980.

気候変動対応支援資金供給
44,214

7/21~ 7/21	15,953.
1/30~ 1/30	28,261.

ETF買入額
356,220

約定 23/ 3/14　701.

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.

社債買入額(月初来)
0

＜3月15日 日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	97,681	CP等買入(推定)	28,600
国債買現先	0	社債等買入(推定)	79,800
被災地金融機関支援	1,716		
気候変動対応支援	44,214		
成長基盤支援	47,971		
貸出増加支援	608,567	手形売出	0
新型コロナ企業金融支援	89,247	国債売現先	0
供給オペ合計	889,396	国債補完供給	46,077
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	889,396	吸収額合計	46,077
差し引き	843,319		

※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15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	+0.001000	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14日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)＞

	残高	増減
市場合計	193,259	+4,640
有担保	29,994	+739
無担保	163,265	+3,901

＜3月15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	-0.060	0.001	-0.023	+0.010				------	-0.091	+0.003
トムネ				------				------	-0.097	+0.003
スポネ			-0.005	± 0				------		
1週間物	-0.040	-0.003	-0.026	-0.001				------	-0.117	± 0
2週間物			-0.020	-0.049				------	-0.132	-0.004
3週間物				------				------	-0.187	-0.004
1ヶ月物			0.030	------				------	-0.182	+0.004
3ヶ月物			0.011	+0.010				------	-0.161	+0.001
6ヶ月物				------				------	-0.109	± 0
1年物				------				------	-0.086	± 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、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いただく場合は、購入対価のみお支払いただきます。
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