

東京短資デイリーレポート

2023/3/17

<3月16日のマネタリーベース>

6,487,200

<3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	5,313,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,219,000
日銀当座預金残高増減前日比	+94,100

<3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		+100
財政等要因		-3,600
資金過不足		-3,500
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-500	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+48,400	-43,800
貸出増加支援	-35,900	+78,300
金融調節合計		+46,400
当座預金増減-②		+42,900

<3月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,261,900
準備預金残高	4,600,400
積み終了先	4,593,400
超過準備	4,424,200
非準備先残高	661,500

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,909,200
今積み期間所要準備額 (平均)	126,100
残り要積立額 (積数)	42,700
残り要積立額 (平均)	1,600
準備進捗率(%)	98.9
日数進捗率(%)	12.9
進捗率乖離幅	+86.0

<3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		0
財政等要因		+82,400
資金過不足		+82,400
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-100	
社債等買入	-400	
国債補完供給	+50,000	
金融調節合計		+49,500
当座預金増減		+131,900

<3月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残539兆3,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.030%~-0.010% での合いが中心か。

<3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	5,438,800	+176,900
+40,000	5,433,800	+171,900
+35,000	5,428,800	+166,900
+30,000	5,423,800	+161,900
+25,000	5,418,800	+156,900
+20,000	5,413,800	+151,900
+15,000	5,408,800	+146,900
+10,000	5,403,800	+141,900
+5,000	5,398,800	+136,900
± 0	5,393,800	+131,900
-5,000	5,388,800	+126,900
-10,000	5,383,800	+121,900
-15,000	5,378,800	+116,900
-20,000	5,373,800	+111,900
-25,000	5,368,800	+106,900
-30,000	5,363,800	+101,900
-35,000	5,358,800	+96,900
-40,000	5,353,800	+91,900
-45,000	5,348,800	+86,900

<3月17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/ 3/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.216%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.332%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/20	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.300%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/17-23/ 3/20	応札	6,104億	落札	6,104億	全取	-1.100% 平均 -2.483%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/17-23/ 3/20	応札	37,274億	落札	37,274億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 3/17-23/ 3/20	応札	0億	落札	0億		
(13:50) 国債補完供給	23/ 3/17-23/ 3/20	応札	100億	落札	100億	全取	-0.350% 平均 -0.350%

<3月17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)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給	
97,681	49,302	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.	3/16(1-3Y) 4,250.	52,200	722,786	5/14~ 5/12 300.	
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	3/16(3-5Y) 5,002.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.	6/11~ 5/12 596.	
1/10~ 1/10 20,011.	3/16(5-10Y) 5,754.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.	8/20~ 8/18 0.	
1/13~ 1/14 20,008.	3/16(25Y-) 503.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16~12/15 20,601.	11/19~11/17 0.	
1/16~ 1/16 20,009.		9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.	2/18~ 2/16 0.	
1/19~ 1/20 1,163.		12/ 4~12/ 4 10,258.		5/17~ 5/17 0.	
3/ 8~ 3/22 6,460.		3/ 4~ 3/ 4 2,178.		8/19~ 8/19 381.	
		6/ 3~ 6/ 3 1,950.		11/18~11/18 93.	
		9/ 2~ 9/ 2 1,804.		2/17~ 2/17 346.	
			※直近約1年分の期落ち分を記載		
			米ドル資金供給オペ		
			1百万ドル		
			3/16~ 3/24 1.		
			※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		
			※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)		
			34,409		
			3/10(5-10Y) 1,551.		
			3/13(5-10Y) 800.		
			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.		
			※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.		
			社債買入額(月初来)		
			0		
			(3/22 1,000.)		
			貸出増加支援		
			650,943	手形売出 0	
			新型コロナウイルス企業金融支援		
			89,247	国債売現先 0	
			供給オペ合計	931,772	国債補完供給 43,478
			貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保) 0
			供給額合計	931,772	吸収額合計 43,478
			差し引き	888,294	

※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	-----	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	0.000000	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16日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	185,524	-4,222
有担保	29,215	-2,336
無担保	156,309	-1,886

<3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	-0.068	0.001	-0.016	+0.005				-----	-0.090	± 0
トムネ				-----				-----	-0.096	+0.001
スポネ			-0.005	± 0				-----		
1週間物	-0.025	-0.005	-0.014	+0.008				-----	-0.115	+0.002
2週間物	-0.020	-0.005	-0.011	+0.005				-----	-0.188	-0.053
3週間物				-----				-----	-0.189	+0.001
1ヶ月物			0.005	-----				-----	-0.184	-0.001
3ヶ月物			0.025	-----				-----	-0.166	-0.004
6ヶ月物				-----				-----	-0.117	-0.006
1年物				-----				-----	-0.091	-0.004

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