

東京短資デイリーレポート

2023/3/23

<3月22日のマネタリーベース>

6,619,100

<3月23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	5,421,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,350,900
日銀当座預金残高増減前日比	+70,400

<3月23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		-1,000
財政等要因		+15,900
資金過不足		+14,900
金融調節		
国庫短期証券買入	期落	新規
		+1,000
CP等買入		-200
社債等買入		-100
国債補完供給	+47,400	-43,600
金融調節合計		+4,500
当座預金増減-②		+19,400

<3月23日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,370,300
準備預金残高	4,684,300
積み終了先	4,681,500
超過準備	4,681,500
非準備先残高	686,000

<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)	25,500
残り要積立額 (平均)	1,100
準備進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	25.8
進捗率乖離幅	+73.5

<3月24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		+200
財政等要因		+30,100
資金過不足		+30,300
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
		-400
社債等買入		-100
ETF買入		+700
国債補完供給	+47,200	
金融調節合計		+47,400
当座預金増減		+77,700

<3月24日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残544兆8,000億円)で 無担保コール0/Nは-0.020%~-0.010% での合いが中心か。

<3月24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	5,493,000	+122,700
+40,000	5,488,000	+117,700
+35,000	5,483,000	+112,700
+30,000	5,478,000	+107,700
+25,000	5,473,000	+102,700
+20,000	5,468,000	+97,700
+15,000	5,463,000	+92,700
+10,000	5,458,000	+87,700
+5,000	5,453,000	+82,700
±0	5,448,000	+77,700
-5,000	5,443,000	+72,700
-10,000	5,438,000	+67,700
-15,000	5,433,000	+62,700
-20,000	5,428,000	+57,700
-25,000	5,423,000	+52,700
-30,000	5,418,000	+47,700
-35,000	5,413,000	+42,700
-40,000	5,408,000	+37,700
-45,000	5,403,000	+32,700

<3月23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/ 3/24	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.177%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/24	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.300%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 3/27-23/ 4/ 3	応札	0mil	落札	0mil	貸付	5.060%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/23-23/ 3/24	応札	3,808億	落札	3,361億	全取	-1.100% 平均 -4.251%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/23-23/ 3/24	応札	40,073億	落札	40,073億	全取	-0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/ 3/23-23/ 3/24	応札	0億	落札	0億		

<3月23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	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
99,722	62,317	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
		1,709百万ドル	1,716
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	3/16(1-3Y) 4,250.	52,200	722,786
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	3/16(3-5Y) 5,002.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	6/19~ 6/19 28,033.
1/10~ 1/10 20,011.	3/16(5-10Y) 5,754.	6/ 5~ 6/ 5 5.	9/17~ 9/15 13,014.
1/13~ 1/14 20,008.	3/16(25Y-) 503.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.	12/16-12/15 20,601.
1/16~ 1/16 20,009.	3/22(1-3Y) 4,256.	9/ 4~ 9/ 4 34.	3/18~ 3/18 41,458.
1/19~ 1/20 1,163.	3/22(5-10Y) 5,755.	12/ 4~12/ 4 10,258.	
3/22~ 4/ 5 8,501.	3/22(10-25Y) 2,001.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	
	3/22(25Y-) 1,003.	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
			米ドル資金供給オペ
			1百万ドル
			3/16~ 3/24 1.
			3/23~ 3/30 0.
			成長基盤強化支援米ドル特別
			(3/24~ 3/30 0.)
			(3/27~ 4/ 3 0.)
			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
			国債買入先オペ
			0
			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.
			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.
			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)(月初末)
			国庫短期証券買入額(月初末)
			4,000
			3/ 1 1,000.
			3/ 8 1,000.
			3/14 1,000.
			3/23 1,000.
			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
			C P買入額(月初末)
			3,980
			3/13 3,980.
			社債買入額(月初末)
			1,000
			3/22 1,000.
			<3月23日 日銀信用概算(除く買切)>
			共通担保(全)固定 99,722 CP等買入(推定) 26,500
			国債買入先 0 社債等買入(推定) 80,300
			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 47,971
			貸出増加支援 650,943 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 933,813 国債補完供給 43,434
			貸出(推定) 0 国債売現先(米ドル担保) 0
			供給額合計 933,813 吸収額合計 43,434
			差し引き 890,379

※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23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 +0.025000	3M 買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M +0.038000	6M 買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M -----	1Y 買気配 -0.100
1M	売気配 -0.020		

<3月22日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	203,843	+6,851
有担保	30,380	+163
無担保	173,463	+6,688

<3月23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	-0.013	+0.001					-0.100	-0.009
トムネ									-0.113	-0.017
スポネ	-0.005	0.001	-0.005	±0						
1週間物	-0.025	-0.004	-0.018	+0.012					-0.119	-0.005
2週間物	-0.020	0.150	0.001	+0.023					-0.196	+0.002
3週間物			0.010						-0.193	+0.003
1ヶ月物			-0.008	-0.023					-0.187	+0.002
3ヶ月物									-0.175	-0.001
6ヶ月物									-0.123	-0.001
1年物									-0.097	-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、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