

東京短資デイリーレポート

2025/1/14

<1月10日のマネタリーベース>

6,513,300

<1月14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	5,218,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,240,400
日銀当座預金残高増減前日比	-21,700

<1月14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		+2,400
財政等要因		-11,500
資金過不足		-9,100
金融調節		
共通担保(全店)	期落	新規
	-20,000	
CP等買入		-100
国債補完供給		+5,600
金融調節合計		-19,900
当座預金増減-②		-29,000

<1月14日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,211,400
準備預金残高	4,700,600
積み終了先	4,700,600
超過準備	4,700,600
非準備先残高	510,800

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,067,000
今積み期間所要準備額(平均)	131,200
残り要積立額(積数)	0
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	96.8
進捗率乖離幅	+3.2

<1月15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		+2,400
財政等要因		-31,800
資金過不足		-29,400
金融調節確定分		
国債補完供給	期落	新規
	+5,400	
金融調節合計		+5,400
当座預金増減		-24,000

<1月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残518兆7,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<1月15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	5,232,400	+21,000
+40,000	5,227,400	+16,000
+35,000	5,222,400	+11,000
+30,000	5,217,400	+6,000
+25,000	5,212,400	+1,000
+20,000	5,207,400	-4,000
+15,000	5,202,400	-9,000
+10,000	5,197,400	-14,000
+5,000	5,192,400	-19,000
±0	5,187,400	-24,000
-5,000	5,182,400	-29,000
-10,000	5,177,400	-34,000
-15,000	5,172,400	-39,000
-20,000	5,167,400	-44,000
-25,000	5,162,400	-49,000
-30,000	5,157,400	-54,000
-35,000	5,152,400	-59,000
-40,000	5,147,400	-64,000
-45,000	5,142,400	-69,000

<1月14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。

(10:40) 米ドル資金供給	25/ 1/16-25/ 1/23	応札	0m1 落札	0m1	貸付	4.580%
(11:50) 国債補完供給	25/ 1/14-25/ 1/15	応札	5,461億	落札	5,461億	全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	25/ 1/14-25/ 1/15	応札	62億	落札	62億	全取 -0.050% 平均 -0.050%

<1月14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			
29,178	10,771	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	863		
1/16~ 1/16 20,009.	1/ 9(1-3Y) 3,001.	28,007	836,939	2/17~ 2/17 346.		
1/19~ 1/20 1,163.	1/ 9(3-5Y) 3,005.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.		
1/ 8~ 1/22 8,006.	1/ 9(5-10Y) 3,258.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.	5/12~ 5/12 181.		
	1/ 9(10-25Y) 1,507.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.	8/19~ 8/18 279.		
		12/ 1~12/ 1 2,464.	12/15~12/15 20,129.	8/18~ 8/18 0.		
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.		11/18~11/17 57.		
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.		11/17~11/17 0.		
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.		2/16~ 2/16 0.		
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.				
			※直近約1年分の期落ち分を記載			
			米ドル資金供給オペ			
			0百万ドル			
			1/ 9~ 1/16 0.			
			(1/16~ 1/23 0.)			
			※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			
			9,918百万ドル			
			3/ 4~ 3/ 4 2,097.			
			6/ 3~ 6/ 3 5,318.			
			9/ 5~ 9/ 5 1,661.			
			12/ 4~12/ 4 842.			
			国債買現先オペ			
			0			
			国債売現先(米ドルオペ用担保)			
			0			
			国庫短期証券買入額(月初来)			
			0			
			国債売現先オペ			
			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)			
			0			
			CP買入額(月初来)			
			0			
			社債買入額(月初来)			
			0			
			※直近約1週間の実施分を記載			
			ETF買入額			
			356,921			
			約定 23/10/ 4 701.			
			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			
			国債補完供給			
			5,523			
			1/14~ 1/15 5,461.			
			1/14~ 1/15 62.			
			ETF買入額			
			356,921			
			約定 23/10/ 4 701.			
			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			
			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。			
			国債買現先			
			0			
			被災地金融機関支援			
			863			
			気候変動対応支援			
			119,626			
			成長基盤支援			
			24,018	手形売出	0	
			貸出増加支援	771,475	国債売現先	0
			供給オペ合計	1,015,195	国債補完供給	5,523
			貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
			供給額合計	1,015,195	吸収額合計	5,523
			差し引き	1,009,672		

<1月14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	売気配 +0.200	1M	-----	3M	買気配 +0.400
1W	売気配 +0.200	2M	買気配 +0.46800	6M	買気配 +0.400
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.500
1M	売気配 +0.200				

<1月10日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	124,985	+519
有担保	42,795	+1,974
無担保	82,190	-1,455

<1月14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	0.220	0.228	0.227	±0			0.180	±0	0.244	+0.001
トムネ				-----				-----	0.245	-0.003
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.300	0.450	0.314	+0.047				-----	0.240	±0
2週間物				-----				-----	0.241	+0.002
3週間物				-----				-----	0.247	+0.004
1ヶ月物				-----				-----	0.255	+0.006
3ヶ月物	0.530	0.610	0.557	-0.053				-----	0.330	+0.005
6ヶ月物				-----				-----	0.397	±0
1年物				-----				-----	0.496	+0.002

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