

# 東京短資デイリーレポート

2025/1/16

## <1月15日のマネタリーベース>

6,457,000
-----------

## <1月16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	5,185,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,189,100
日銀当座預金残高増減前日比	-3,200

## <1月16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		+2,300
財政等要因		-200
資金過不足		+2,100
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+11,200
共通担保(全店)	-20,000	
国債補完供給	+4,700	-4,100
金融調節合計		-8,200
当座預金増減-②		-6,100

## <1月16日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,183,000
準備預金残高	4,673,200
積み終了先	3,200,600
超過準備	1,234,900
非準備先残高	509,800

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,074,100
今積み期間所要準備額 (平均)	131,400
残り要積立額 (積数)	635,800
残り要積立額 (平均)	21,200
準備進捗率(%)	84.3
日数進捗率(%)	3.2
進捗率乖離幅	+81.1

## <1月17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		+2,600
財政等要因		-1,200
資金過不足		+1,400
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-200	
国債補完供給	+4,100	
金融調節合計		+3,900
当座預金増減		+5,300

## <1月17日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残518兆8,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。
---

## <1月17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	5,233,300	+50,300
+40,000	5,228,300	+45,300
+35,000	5,223,300	+40,300
+30,000	5,218,300	+35,300
+25,000	5,213,300	+30,300
+20,000	5,208,300	+25,300
+15,000	5,203,300	+20,300
+10,000	5,198,300	+15,300
+5,000	5,193,300	+10,300
± 0	5,188,300	+5,300
-5,000	5,183,300	+300
-10,000	5,178,300	-4,700
-15,000	5,173,300	-9,700
-20,000	5,168,300	-14,700
-25,000	5,163,300	-19,700
-30,000	5,158,300	-24,700
-35,000	5,153,300	-29,700
-40,000	5,148,300	-34,700
-45,000	5,143,300	-39,700

## <1月16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。

(11:50) 国債補完供給	25/ 1/16-25/ 1/17	応札 4,231億 落札 4,231億 全取 -0.050% 平均 -0.050%
(13:50) 国債補完供給	25/ 1/16-25/ 1/17	応札 0億 落札 0億

## <1月16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
9,169	22,291	成長基盤強化支援資金供給	863
1/19~ 1/20 1,163.	1/ 9(1-3Y) 3,001.	28,007	836,939
1/ 8~ 1/22 8,006.	1/ 9(3-5Y) 3,005.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
	1/ 9(5-10Y) 3,258.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.
	1/ 9(10-25Y) 1,507.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.
	1/16(-1Y) 1,503.	12/ 1~12/ 1 2,464.	12/15~12/15 20,129.
	1/16(1-3Y) 3,002.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	
	1/16(3-5Y) 3,005.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	
	1/16(5-10Y) 3,259.	3/ 4~ 3/ 4 2,097.	
	1/16(25Y-) 751.	6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
		※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.	
		国債買入先オペ	
		0	国債売入先(米ドルオペ用担保)
			0
			国庫短期証券買入額(月初来)
			0
			国債売入先オペ
			0
			CP買入額(月初来)
			0
			社債買入額(月初来)
			0
			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

## <1月16日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	9,169	CP等買入(推定)	14,500
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	51,000
国債買入先	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	国債売入先	0
供給オペ合計	995,186	国債補完供給	4,231
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	995,186	吸収額合計	4,231
	差し引き	990,955	

※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。

## <1月16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	+0.472000	6M	買気配 +0.450
2W	売気配 +0.200	3M	+0.533000	1Y	買気配 +0.450
1M	売気配 +0.200				

## <1月15日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	125,819	+2,880
有担保	42,870	+676
無担保	82,949	+2,204

## <1月16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	0.241	-0.003
トムネ				-----				-----	0.244	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.232	0.290	0.271	-0.003				-----	0.241	+0.001
2週間物				-----				-----	0.255	+0.011
3週間物				-----				-----	0.269	+0.016
1ヶ月物				-----				-----	0.291	+0.024
3ヶ月物			0.485	-----				-----	0.349	+0.015
6ヶ月物				-----				-----	0.410	+0.012
1年物				-----				-----	0.500	+0.003

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