

東京短資デイリーレポート

2025/1/21

<1月20日のマネタリーベース>

6,450,600

<1月21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	5,196,300
前日の日銀当座預金残高-①	5,189,300
日銀当座預金残高増減前日比	+7,000

<1月21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		+1,700
財政等要因		+9,700
資金過不足		+11,400
金融調節		
国債補完供給	+4,800	-4,800
金融調節合計		± 0
当座預金増減-②		+11,400

<1月21日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,200,700
準備預金残高	4,698,000
積み終了先	4,693,800
超過準備	4,693,800
非準備先残高	502,700

<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)	22,900
残り要積立額 (平均)	900
準備進捗率(%)	99.4
日数進捗率(%)	19.4
進捗率乖離幅	+80.0

<1月22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		+1,400
財政等要因		-7,400
資金過不足		-6,000
金融調節確定分		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+4,800	
金融調節合計		+4,800
当座預金増減		-1,200

<1月22日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残519兆9,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<1月22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	5,244,500	+43,800
+40,000	5,239,500	+38,800
+35,000	5,234,500	+33,800
+30,000	5,229,500	+28,800
+25,000	5,224,500	+23,800
+20,000	5,219,500	+18,800
+15,000	5,214,500	+13,800
+10,000	5,209,500	+8,800
+5,000	5,204,500	+3,800
± 0	5,199,500	-1,200
-5,000	5,194,500	-6,200
-10,000	5,189,500	-11,200
-15,000	5,184,500	-16,200
-20,000	5,179,500	-21,200
-25,000	5,174,500	-26,200
-30,000	5,169,500	-31,200
-35,000	5,164,500	-36,200
-40,000	5,159,500	-41,200
-45,000	5,154,500	-46,200

<1月21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/ 1/23-25/ 1/30	応札 3m1l 落札 3m1l	貸付 4.580%
(11:50) 国債補完供給	25/ 1/21-25/ 1/22	応札 4,905億 落札 4,905億 全取 -0.050% 平均 -0.050%	
(13:00) 共通担保(全)固	25/ 1/22-25/ 2/ 5	8,000億 応札 36,115億 落札 8,006億	貸付 0.250% 按分 22.2%
(13:50) 国債補完供給	25/ 1/21-25/ 1/22	応札 53億 落札 53億 全取 -0.050% 平均 -0.050%	
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	25/ 1/22-25/ 1/31	5,000億 応札 4億 落札 4億 全取 +0.220% 平均 +0.220%	

<1月21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	
8,006	2,291	成長基盤強化支援資金供給	863	
1/ 8~ 1/22 8,006. (1/22~ 2/ 5 8,006.)	1/16(-1Y) 1,503. 1/16(1-3Y) 3,002. 1/16(3-5Y) 3,005. 1/16(5-10Y) 3,259. 1/16(25Y-) 751.	28,007 3/ 3~ 3/ 3 6,793. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 12/ 1~12/ 1 2,464. 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 6/ 3~ 6/ 3 3,160. 3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 3~ 6/ 3 5,318.	836,939 3/17~ 3/17 64,498. 6/18~ 6/18 26,498. 9/15~ 9/12 27,659. 12/15~12/15 20,129. ※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 1/16~ 1/23 0. (1/23~ 1/30 3.)	2/17~ 2/17 346. 5/17~ 5/12 0. 5/12~ 5/12 181. 8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/18~11/17 57. 11/17~11/17 0. 2/16~ 2/16 0.
共通担保(全店)金利入札	70,035	成長基盤強化支援米ドル特別	9,918百万ドル	
1/24~ 1/24 10,003. 2/ 1~ 2/ 1 10,004. 2/15~ 2/15 10,004. 3/ 1~ 3/ 1 10,010. 9/15~ 9/15 10,005. 10/10~10/10 10,006. 10/25~10/25 10,003.	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	
国債補完供給	4,958	国債売先オペ	0	
1/21~ 1/22 4,905. 1/21~ 1/22 53.	0	国債買入額(固定利回)(月初来)	0	
ETF買入額	356,921	CP買入額(月初来)	0	
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	14,628	社債買入額(月初来)	0	
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額	6,823	(1/23 250.)		
約定 22/ 6/14 12.				

※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21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 +0.350
1W	売気配 +0.200	2M	-----	6M	買気配 +0.450
2W	売気配 +0.200	3M	-----	1Y	買気配 +0.550
1M	売気配 +0.200				

<1月20日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	127,861	-29
有担保	42,872	-88
無担保	84,989	+59

<1月21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	0.275	0.228	+0.001			0.180	± 0	0.238	-0.010
トムネ				-----				-----	0.238	-0.006
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.270	0.550	0.359	+0.127				-----	0.276	+0.021
2週間物				-----				-----	0.317	+0.013
3週間物				-----				-----	0.350	+0.016
1ヶ月物				-----				-----	0.388	+0.019
3ヶ月物				-----				-----	0.420	+0.010
6ヶ月物				-----				-----	0.451	+0.006
1年物				-----				-----	0.530	+0.010

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