

東京短資デイリーレポート

2025/1/22

<1月21日のマネタリーベース>

6,460,200

<1月22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	5,199,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,200,700
日銀当座預金残高増減前日比	-1,200

<1月22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		+1,600
財政等要因		-3,000
資金過不足		-1,400
金融調節		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+4,800	-5,600
金融調節合計		-800
当座預金増減-②		-2,200

<1月22日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,198,500
準備預金残高	4,694,400
積み終了先	4,690,200
超過準備	4,690,200
非準備先残高	504,100

<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)	18,600
残り要積立額(平均)	800
準備進捗率(%)	99.5
日数進捗率(%)	22.6
進捗率乖離幅	+76.9

<1月23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		+1,100
財政等要因		+10,600
資金過不足		+11,700
金融調節確定分		
国債買入		+10,500
社債等買入	-200	+300
国債補完供給	+5,600	
金融調節合計		+16,200
当座預金増減		+27,900

<1月23日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残522兆6,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.220%~+0.227% での合いが中心か。

<1月23日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,271,400	+72,900
+40,000	5,266,400	+67,900
+35,000	5,261,400	+62,900
+30,000	5,256,400	+57,900
+25,000	5,251,400	+52,900
+20,000	5,246,400	+47,900
+15,000	5,241,400	+42,900
+10,000	5,236,400	+37,900
+5,000	5,231,400	+32,900
±0	5,226,400	+27,900
-5,000	5,221,400	+22,900
-10,000	5,216,400	+17,900
-15,000	5,211,400	+12,900
-20,000	5,206,400	+7,900
-25,000	5,201,400	+2,900
-30,000	5,196,400	-2,100
-35,000	5,191,400	-7,100
-40,000	5,186,400	-12,100
-45,000	5,181,400	-17,100

<1月22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(1Y-3Y)	25/ 1/23	3,000億	応札 10,609億	落札 3,001億	最低 +0.016%	平均 +0.018%	按分 17.1%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	25/ 1/23	3,000億	応札 10,299億	落札 3,002億	最低 +0.018%	平均 +0.020%	按分 10.8%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 1/23	3,250億	応札 8,128億	落札 3,258億	最低 +0.012%	平均 +0.013%	按分 45.2%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 1/23	1,500億	応札 2,984億	落札 1,504億	最低 +0.018%	平均 +0.022%	按分 18.2%
(11:50) 国債補完供給	25/ 1/22-25/ 1/23		応札 5,758億	落札 5,758億	全取 -0.050%	平均 -0.050%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 1/22-25/ 1/23		応札 51億	落札 51億	全取 -0.050%	平均 -0.050%	

<1月22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)	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
8,006	22,291			863
1/22~ 2/ 5	8,006.	1/16(-1Y) 1,503.	28,007	836,939
		1/16(1-3Y) 3,002.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
		1/16(3-5Y) 3,005.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	5/17~ 5/12 0.
		1/16(5-10Y) 3,259.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	5/12~ 5/12 181.
		1/16(25Y-) 751.	12/ 1~12/ 1 2,464.	8/19~ 8/18 279.
		(1/23(1-3Y) 3,001.)	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	8/18~ 8/18 0.
		(1/23(3-5Y) 3,002.)	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	11/18~11/17 57.
		(1/23(5-10Y) 3,258.)	3/ 4~ 3/ 4 2,097.	11/17~11/17 0.
		(1/23(10-25Y) 1,504.)	6/ 3~ 6/ 3 5,318.	2/16~ 2/16 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)	
				4
			1/22~ 1/31	4.
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			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(固定利回り)(月初末)	
			0	
			CP買入額(月初末)	
			0	
			社債買入額(月初末)	
			0	
			(1/23 250.)	
			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	
			CP等買入(推定)	14,400
			社債等買入(推定)	50,700
			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	994,023
			国債補完供給	5,809
			貸出(推定)	0
			国売現(米ドル担保)	4
			供給額合計	994,023
			吸収額合計	5,813
			差し引き	988,210

※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22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	+0.515000	3M	買気配 +0.400
1W	売気配 +0.200	2M	+0.570000	6M	買気配 +0.450
2W	売気配 +0.200	3M	+0.640000	1Y	買気配 +0.550
1M	売気配 +0.200				

<1月21日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	125,905	-1,956
有担保	41,679	-1,193
無担保	84,226	-763

<1月22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	0.219	0.275	0.228	±0			0.180	±0	0.236	-0.002
トムネ				-----				-----	0.222	-0.016
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.250	0.550	0.291	-0.068				-----	0.292	+0.016
2週間物				-----				-----	0.327	+0.010
3週間物				-----				-----	0.360	+0.010
1ヶ月物				-----				-----	0.393	+0.005
3ヶ月物				-----				-----	0.427	+0.007
6ヶ月物				-----				-----	0.456	+0.005
1年物				-----				-----	0.538	+0.008

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