

東京短資デイリーレポート

2023/6/27

<6月26日のマネタリーベース>

6,779,600

<6月27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	5,557,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,519,600
日銀当座預金残高増減前日比	+37,600

<6月27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		-1,200
資金過不足		-2,200
金融調節		
CP等買入	期落	新規
		-100
国債補完供給	+38,700	-37,500
金融調節合計		+1,100
当座預金増減-②		-1,100

<6月27日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,518,500
準備預金残高	4,870,000
積み終了先	4,868,100
超過準備	4,868,100
非準備先残高	648,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,883,300
今積み期間所要準備額(平均)	129,400
残り要積立額(積数)	11,900
残り要積立額(平均)	700
準備進捗率(%)	99.6
日数進捗率(%)	40.0
進捗率乖離幅	+59.6

<6月28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		-400
財政等要因		-19,500
資金過不足		-19,900
金融調節確定分		
国庫短期証券買入	期落	新規
		+1,000
CP等買入		-300
国債補完供給	+37,500	
金融調節合計		+38,200
当座預金増減		+18,300

<6月28日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残553兆6,800億円)で 無担保コール0/Nは-0.080%~-0.070% での合いが中心か。

<6月28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	5,581,800	+63,300
+40,000	5,576,800	+58,300
+35,000	5,571,800	+53,300
+30,000	5,566,800	+48,300
+25,000	5,561,800	+43,300
+20,000	5,556,800	+38,300
+15,000	5,551,800	+33,300
+10,000	5,546,800	+28,300
+5,000	5,541,800	+23,300
±0	5,536,800	+18,300
-5,000	5,531,800	+13,300
-10,000	5,526,800	+8,300
-15,000	5,521,800	+3,300
-20,000	5,516,800	-1,700
-25,000	5,511,800	-6,700
-30,000	5,506,800	-11,700
-35,000	5,501,800	-16,700
-40,000	5,496,800	-21,700
-45,000	5,491,800	-26,700

<6月27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/ 6/28	応札	0億	落札	0億	固定利回差差	+0.150%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 6/28	応札	0億	落札	0億	固定利回差差	+0.339%
(10:10) 国庫短期証券買入	23/ 6/28	1,000億	応札	7,854億	落札	1,000億	最低 +0.023% 平均 +0.024% 按分 33.0%
(10:40) ミドル資金供給	23/ 6/29-23/ 7/ 7	応札	1ml	落札	1ml	貸付	5.330%
(10:40) CP買入	23/ 6/30	4,000億	応札	7,218億	落札	3,996億	最低 0.000% 平均 +0.014% 按分 59.2%
(11:50) 国債補完供給	23/ 6/27-23/ 6/28	応札	37,390億	落札	37,390億	全取 -0.350% 平均 -0.351%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 6/27-23/ 6/28	応札	35億	落札	35億	全取 -0.350% 平均 -0.350%	
(14:45) ミドルオペ用担保供給	23/ 6/28-23/ 7/10	5,000億	応札	2億	落札	2億	全取 -0.100% 平均 -0.100%

<6月27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)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給			
100,131	57,319	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1,001			
6/21~ 7/ 5	8,910.	47,883	754,212	8/20~ 8/18	0.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	9/17~ 9/15	13,014.	11/19~11/17	0.
1/ 5~ 1/ 6	20,016.	9/ 4~ 9/ 4	34.	12/16~12/15	20,601.	2/18~ 2/16	0.
1/10~ 1/10	20,011.	12/ 4~12/ 4	10,258.	3/18~ 3/18	41,458.	5/17~ 5/17	0.
1/13~ 1/14	20,008.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	6/19~ 6/19	63,179.	8/19~ 8/19	381.
1/16~ 1/16	20,009.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	※直近約1年分の期落ち分を記載		11/18~11/18	93.
1/19~ 1/20	1,163.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	※直近約1年分の期落ち分を記載		2/17~ 2/17	346.
		12/ 2~12/ 2	1,712.	米ドル資金供給オペ		5/12~ 5/12	181.
		3/ 3~ 3/ 3	6,793.	1百万ドル			
				6/22~ 6/29	1.		
				(6/29~ 7/ 7	1.)		
				※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			
				17,427百万ドル			
				9/ 2~ 9/ 5	6,101.		
				12/ 2~12/ 4	3,607.		
				3/ 3~ 3/ 4	2,153.		
				6/ 2~ 6/ 3	5,566.		
				国債買現先オペ			
				0	国債売現先(米ドルオペ用担保)		
					0		
					(6/28~ 7/10	2.)	
					国庫短期証券買入額(月初末)		
					国債売現先オペ		
					3,004		
					0		
					6/ 7	1,001.	
					6/14	1,002.	
					6/22	1,001.	
					(6/28	1,000.)	
					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.	
					国債買現先オペ		
					0		
					CP買入額(月初末)		
					3,996		
					6/13	3,996.	
					(6/30	3,996.)	
					社債買入額(月初末)		
					1,002		
					6/22	1,002.	
					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		

※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。

<6月27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 +0.019000	3M 買気配 -0.130
1W 売気配 -0.020	2M -----	6M 買気配 -0.100
2W 売気配 -0.020	3M +0.013000	1Y 買気配 -0.030
1M 売気配 -0.020		

<6月26日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	168,479	-7,143
有担保	30,437	+1,664
無担保	138,042	-8,807

<6月27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	-0.087	0.001	-0.074	+0.001					-0.085	+0.001
トムネ				-----					-0.086	±0
スポネ				-----						
1週間物				-----					-0.115	+0.004
2週間物				-----					-0.117	+0.005
3週間物			0.150	+0.220					-0.126	+0.002
1ヶ月物				-----					-0.126	+0.006
3ヶ月物				-----					-0.136	+0.006
6ヶ月物				-----					-0.132	+0.001
1年物				-----					-0.102	±0

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