

東京短資デイリーレポート

2024/6/13

<6月12日のマネタリーベース>

6,627,900

<6月13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	5,435,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,390,900
日銀当座預金残高増減前日比	+44,800

<6月13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		-100
財政等要因		-5,400
資金過不足		-5,500
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+12,900
CP等買入	-200	
国債補完供給	+33,300	-35,100
金融調節合計		+10,900
当座預金増減-②		+5,400

<6月13日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,396,300
準備預金残高	4,755,400
積み終了先	4,755,400
超過準備	4,755,400
非準備先残高	640,900

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,081,200
今積み期間所要準備額 (平均)	131,700
残り要積立額 (積数)	200
残り要積立額 (平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	93.5
進捗率乖離幅	+6.4

<6月14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		+600
財政等要因		+77,200
資金過不足		+77,800
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-300	+3,000
社債等買入	-100	
国債補完供給	+35,100	
金融調節合計		+37,700
当座預金増減		+115,500

<6月14日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆1,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<6月14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	5,556,800	+160,500
+40,000	5,551,800	+155,500
+35,000	5,546,800	+150,500
+30,000	5,541,800	+145,500
+25,000	5,536,800	+140,500
+20,000	5,531,800	+135,500
+15,000	5,526,800	+130,500
+10,000	5,521,800	+125,500
+5,000	5,516,800	+120,500
±0	5,511,800	+115,500
-5,000	5,506,800	+110,500
-10,000	5,501,800	+105,500
-15,000	5,496,800	+100,500
-20,000	5,491,800	+95,500
-25,000	5,486,800	+90,500
-30,000	5,481,800	+85,500
-35,000	5,476,800	+80,500
-40,000	5,471,800	+75,500
-45,000	5,466,800	+70,500

<6月13日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 6/13-24/ 6/14	応札 35,325億 落札 35,325億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 6/13-24/ 6/14	応札 607億 落札 607億 全取 -0.250% 平均 -0.250%

<6月13日 各オペ残高と内訳>

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			
9,9,2,2,7		35,413		成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1,001			
6/12~ 6/26	8,006.	6/10(-1Y)	1,501.	31,523	864,191	8/19~ 8/19	381.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	6/10(1-3Y)	3,753.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	6/19~ 6/19	63,179.	11/18~11/18	93.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	6/10(5-10Y)	4,262.	12/ 2~12/ 2	1,712.	9/16~ 9/13	132,310.	2/17~ 2/17	346.
1/10~ 1/10	20,011.	6/10(10-25Y)	1,507.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	12/15~12/13	54,701.	5/17~ 5/12	0.
1/13~ 1/14	20,008.	6/13(1-3Y)	3,752.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.	3/17~ 3/17	64,498.	5/12~ 5/12	181.
1/16~ 1/16	20,009.	6/13(3-5Y)	4,252.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.	※直近約1年分の期落ち分を記載		8/18~ 8/18	0.
1/19~ 1/20	1,163.	6/13(5-10Y)	4,262.	12/ 1~12/ 1	2,464.	米ドル資金供給オペ		11/17~11/17	0.
		6/13(25Y-)	752.	3/ 2~ 3/ 2	7,922.	0百万ドル		2/16~ 2/16	0.
				6/ 3~ 6/ 3	3,160.	6/13~ 6/21		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					
				16,122百万ドル					
				9/ 5~ 9/ 5	5,382.				
				12/ 4~12/ 4	3,325.				
				3/ 4~ 3/ 4	2,097.				
				6/ 3~ 6/ 3	5,318.				
				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)			
				国債売現先オペ		0			
				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					
				国債補完供給					
				35,932					
				6/13~ 6/14	35,325.				
				6/13~ 6/14	607.				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				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					
				C P買入額(月初来)					
				0					
				(6/14	3,000.)				
				社債買入額(月初来)					
				0					
		</							