

# 東京短資デイリーレポート

2024/6/14

## <6月13日のマネタリーベース>

6,633,400
-----------

## <6月14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	5,511,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,396,300
日銀当座預金残高増減前日比	+115,500

## <6月14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	+50	
財政等要因	+78,600	
資金過不足	+79,100	
金融調節		
	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	-34,500
金融調節合計		+3,200
当座預金増減-②		+82,300

## <6月14日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,478,600
準備預金残高	4,828,200
積み終了先	4,828,200
超過準備	4,828,100
非準備先残高	650,400

## <参考>

翌積み期間所要準備額 (積数)	3,942,000
翌積み期間所要準備額 (平均)	131,400
残り要積立額 (積数)	492,100
残り要積立額 (平均)	17,000
準備進捗率(%)	87.5
日数進捗率(%)	3.3
進捗率乖離幅	+84.2

## <6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	+800	
財政等要因	-700	
資金過不足	+100	
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補完供給	+34,500	
金融調節合計		+34,400
当座預金増減		+34,500

## <6月17日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残551兆3,100億円)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	5,558,100	+79,500
+40,000	5,553,100	+74,500
+35,000	5,548,100	+69,500
+30,000	5,543,100	+64,500
+25,000	5,538,100	+59,500
+20,000	5,533,100	+54,500
+15,000	5,528,100	+49,500
+10,000	5,523,100	+44,500
+5,000	5,518,100	+39,500
± 0	5,513,100	+34,500
-5,000	5,508,100	+29,500
-10,000	5,503,100	+24,500
-15,000	5,498,100	+19,500
-20,000	5,493,100	+14,500
-25,000	5,488,100	+9,500
-30,000	5,483,100	+4,500
-35,000	5,478,100	-500
-40,000	5,473,100	-5,500
-45,000	5,468,100	-10,500

## <6月14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	24/ 6/14-24/ 6/17	応札 35,440億 落札 35,440億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 6/14-24/ 6/17	応札 1億 落札 1億 全取 -0.250% 平均 -0.250%

## <6月14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 9,227	35,413	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
6/12~ 6/26 8,006.	6/10(-1Y) 1,501.	3 1,523	8 64,191
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	6/10(1-3Y) 3,753.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	6/19~ 6/19 63,179.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	6/10(5-10Y) 4,262.	12/ 2~12/ 2 1,712.	9/16~ 9/13 132,310.
1/10~ 1/10 20,011.	6/10(10-25Y) 1,507.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	12/15~12/13 54,701.
1/13~ 1/14 20,008.	6/13(1-3Y) 3,752.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	3/17~ 3/17 64,498.
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
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
	6/13(25Y-) 752.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	0百万ドル
		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	
		1 6,122百万ドル	
		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)(月初来)	
		0	
		国債補完供給	
		35,441	
		6/14~ 6/17 35,440.	
		6/14~ 6/17 1.	
		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買入額(月初来)	
		3,000	
		6/14 3,000.	
		社債買入額(月初来)	
		0	
		国債買現先	
		0	
		被災地金融機関支援	
		1,001	
		気候変動対応支援	
		81,663	
		成長基盤支援	27,076
		貸出増加支援	782,979
		供給オペ合計	1,061,981
		貸出(推定)	0
		供給額合計	1,061,981
		手形売出	0
		国債売現先	0
		国債補完供給	35,441
		国売現(米ドル担保)	0
		吸収額合計	35,441
		差し引き	1,026,540

※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14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	+0.070	1M	+0.125000	3M	買気配 +0.050
1W	売気配 +0.070	2M	-----	6M	買気配 +0.100
2W	売気配 +0.070	3M	+0.210000	1Y	買気配 +0.220
1M	売気配 +0.070				

## <6月13日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	116,797	+1,655
有担保	39,354	+861
無担保	77,443	+794

## <6月14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	0.040	0.150	0.077	± 0				-----	0.037	+0.026
トムネ				-----				-----	0.032	+0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.043	-0.005
2週間物			0.130	-----				-----	0.043	-0.006
3週間物				-----				-----	0.044	-0.006
1ヶ月物			0.230	+0.025				-----	0.041	-0.007
3ヶ月物			0.200	± 0				-----	0.086	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.135	+0.001
1年物				-----				-----	0.200	± 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