

東京短資デイリーレポート

2024/6/17

<6月14日のマナリーベース>

6,715,100

<6月17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	5,513,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,478,600
日銀当座預金残高増減前日比	+34,500

<6月17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		+700
財政等要因		+700
資金過不足		+1,400
金融調節		
CP等買入	期落	新規
	-100	
国債補完供給	+34,500	-31,400
金融調節合計		+3,000
当座預金増減-②		+4,400

<6月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,483,000
準備預金残高	4,844,300
積み終了先	4,759,100
超過準備	4,438,100
非準備先残高	638,700

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,942,000
今積み期間所要準備額(平均)	131,400
残り要積立額(積数)	74,900
残り要積立額(平均)	2,700
準備進捗率(%)	98.0
日数進捗率(%)	6.7
進捗率乖離幅	+91.3

<6月18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		+700
財政等要因		+7,000
資金過不足		+7,700
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
	-100	
国債補完供給	+31,400	
金融調節合計		+31,300
当座預金増減		+39,000

<6月18日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残552兆2,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での出合いが中心か。
--

<6月18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	5,567,000	+84,000
+40,000	5,562,000	+79,000
+35,000	5,557,000	+74,000
+30,000	5,552,000	+69,000
+25,000	5,547,000	+64,000
+20,000	5,542,000	+59,000
+15,000	5,537,000	+54,000
+10,000	5,532,000	+49,000
+5,000	5,527,000	+44,000
±0	5,522,000	+39,000
-5,000	5,517,000	+34,000
-10,000	5,512,000	+29,000
-15,000	5,507,000	+24,000
-20,000	5,502,000	+19,000
-25,000	5,497,000	+14,000
-30,000	5,492,000	+9,000
-35,000	5,487,000	+4,000
-40,000	5,482,000	-1,000
-45,000	5,477,000	-6,000

<6月17日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 6/17-24/ 6/18	応札 32,187億 落札 32,187億 全取 -0.250% 平均 -0.250%
(13:50) 国債補完供給	24/ 6/17-24/ 6/18	応札 0億 落札 0億
(9:30) 貸出増加支援	24/ 6/19-25/ 6/18	67,646億 貸付 0.000% 先数 50先

<6月17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
99,227	35,413	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	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.		8/18~8/18 0.
1/19~1/20 1,163.	6/13(5-10Y) 4,262.	12/ 1~12/ 1 2,464.		11/17~11/17 0.
	6/13(25Y-) 752.	3/ 2~3/ 2 7,922.		2/16~2/16 0.
		6/ 3~6/ 3 3,160.		
※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)				
0				
国債売現先オペ				
0				
C P 買入額(月初来)				
3,000				
6/14 3,000.				
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				

<6月17日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	99,227	CP等買入(推定)	21,900
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	58,700
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	手形売出	0
貸出増加支援	782,979	国債売現先	0
供給オペ合計	1,061,981	国債補完供給	32,187
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	1,061,981	吸収額合計	32,187
		差し引き	1,029,794

※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17日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先	CPプライマリ	TBアウトライト
+0.070	1M	+0.110000	3M 買気配 +0.050
1W 売気配 +0.070	2M	+0.190000	6M 買気配 +0.100
2W 売気配 +0.070	3M	+0.189000	1Y 買気配 +0.220
1M 売気配 +0.070			

<6月14日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	115,510	-1,287
有担保	38,764	-590
無担保	76,746	-697

<6月17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	0.045	0.080	0.077	±0					0.073	+0.036
トムネ									0.056	+0.024
スポネ										
1週間物			0.150						0.049	+0.006
2週間物			0.210	+0.080					0.044	+0.001
3週間物									0.046	+0.002
1ヶ月物	0.200	0.310	0.236	+0.006					0.044	+0.003
3ヶ月物									0.085	-0.001
6ヶ月物									0.136	+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