

東京短資デイリーレポート

2024/6/25

<6月24日のマネタリーベース>

6,774,900

<6月25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	5,585,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,539,400
日銀当座預金残高増減前日比	+45,600

<6月25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		0
財政等要因		+5,400
資金過不足		+5,400
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+12,200
CP等買入	-300	
社債等買入	-300	
国債補完供給	+25,000	-26,900
金融調節合計		+9,700
当座預金増減-②		+15,100

<6月25日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,554,500
準備預金残高	4,951,600
積み終了先	4,950,300
超過準備	4,949,800
非準備先残高	602,900

<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)	4,100
残り要積立額 (平均)	200
準備進捗率 (%)	99.8
日数進捗率 (%)	33.3
進捗率乖離幅	+66.5

<6月26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		-100
財政等要因		-17,900
資金過不足		-18,000
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
CP等買入	-200	
国債補完供給	+26,900	
金融調節合計		+26,700
当座預金増減		+8,700

<6月26日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残556兆3,200億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<6月26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	5,608,200	+53,700
+40,000	5,603,200	+48,700
+35,000	5,598,200	+43,700
+30,000	5,593,200	+38,700
+25,000	5,588,200	+33,700
+20,000	5,583,200	+28,700
+15,000	5,578,200	+23,700
+10,000	5,573,200	+18,700
+5,000	5,568,200	+13,700
± 0	5,563,200	+8,700
-5,000	5,558,200	+3,700
-10,000	5,553,200	-1,300
-15,000	5,548,200	-6,300
-20,000	5,543,200	-11,300
-25,000	5,538,200	-16,300
-30,000	5,533,200	-21,300
-35,000	5,528,200	-26,300
-40,000	5,523,200	-31,300
-45,000	5,518,200	-36,300

<6月25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。

(10:40) 米ドル資金供給	24/ 6/27-24/ 7/ 5	応札 0m1 落札 0m1	貸付 5.580%
(10:40) C P買入	24/ 6/28	3,000億 応札 6,250億 落札 2,995億	最低 +0.167% 平均 +0.184% 按分 68.8%
(11:50) 国債補完供給	24/ 6/25-24/ 6/26	応札 27,512億 落札 27,512億	全取 -0.150% 平均 -0.164%
(13:00) 共通担保(全店)	24/ 6/26-24/ 7/10	8,000億 応札 9,595億 落札 8,005億	貸付 0.100% 按分 83.4%
(13:50) 国債補完供給	24/ 6/25-24/ 6/26	応札 0億 落札 0億	

<6月25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
9,227	61,434	成長基盤強化支援資金供給	1,001
6/12~ 6/26 8,006. (6/26~ 7/10 8,005.)	6/19(1-3Y) 3,751. 6/19(3-5Y) 4,253. 6/19(5-10Y) 4,256. 6/19(10-25Y) 1,502.	31,523 868,658	8/19~ 8/19 381. 11/18~11/18 93. 2/17~ 2/17 346. 5/17~ 5/12 0. 5/12~ 5/12 181. 8/18~ 8/18 0. 11/17~11/17 0. 2/16~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016. 1/ 6~ 1/ 6 20,014. 1/10~ 1/10 20,011. 1/13~ 1/14 20,008. 1/16~ 1/16 20,009. 1/19~ 1/20 1,163.	6/25(1-3Y) 3,751. 6/25(3-5Y) 4,253. 6/25(5-10Y) 4,255.	12/ 2~12/ 2 1,712. 3/ 3~ 3/ 3 6,793. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 12/ 1~12/ 1 2,464. 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 6/ 3~ 6/ 3 3,160.	12/15~12/13 54,701. 3/17~ 3/17 64,498. 6/18~ 6/18 26,498. ※直近約1年分の期落ち分を記載 米ドル資金供給オペ 1百万ドル 6/21~ 6/27 1. (6/27~ 7/ 5 0.)
共通担保(全店)金利入札		※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	気候変動対応支援資金供給
70,035		16,122百万ドル	81,666
1/24~ 1/24 10,003. 2/ 1~ 2/ 1 10,004. 2/15~ 2/15 10,004. 3/ 1~ 3/ 1 10,010. 9/15~ 9/15 10,005. 10/10~10/10 10,006. 10/25~10/25 10,003.		9/ 5~ 9/ 5 5,382. 12/ 4~12/ 4 3,325. 3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 3~ 6/ 3 5,318.	7/21~ 7/19 34,398. 1/30~ 1/30 47,268.
国債補完供給		国債買現先オペ	
27,512		0	
6/25~ 6/26 27,512. 6/25~ 6/26 0.		国債売現先(米ドルオペ用担保)	
		0	
ETF買入額		国債売現先オペ	
356,921		0	
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)		国庫短期証券買入額(月初末)	
14,628		0	
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額		国債買入額(固定利回)(月初末)	
6,823		0	
約定 22/ 6/14 12.		※直近約1週間の実施分を記載	
CP買入額(月初末)		CP買入額(月初末)	
		3,000	
		(6/28 2,995.)	
社債買入額(月初末)		社債買入額(月初末)	
		750	
		6/21 750.	
国債買現先オペ		国債買現先(米ドルオペ用担保)	
		0	
国債売現先オペ		国債売現先(米ドルオペ用担保)	
		0	
国庫短期証券買入額(月初末)		国庫短期証券買入額(月初末)	
		0	
C P買入額(月初末)		C P買入額(月初末)	
		3,000	
		(6/28 2,995.)	
ETF買入額		ETF買入額	
		356,921	
		約定 23/10/ 4 701.	
ETF買入額(企業支援)		ETF買入額(企業支援)	
		14,628	
		約定 21/ 3/31 12.	
J-REIT買入額		J-REIT買入額	
		6,823	
		約定 22/ 6/14 12.	
※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25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 +0.110000	3M 買気配 +0.030
1W 売気配 +0.070	2M +0.180000	6M 買気配 +0.100
2W 売気配 +0.070	3M +0.230000	1Y 買気配 +0.220
1M 売気配 +0.070		

<6月24日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	124,498	+7,518
有担保	37,748	-282
無担保	86,750	+7,800

<6月25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	0.065	0.150	0.078	-0.003					0.077	-0.007
トムネ									0.084	-0.002
スポネ										
1週間物			0.280						0.051	± 0
2週間物									0.052	-0.001
3週間物									0.052	± 0
1ヶ月物									0.052	± 0
3ヶ月物									0.084	+0.001
6ヶ月物			0.400						0.139	+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