

東京短資デイリーレポート

2024/6/27

<6月26日のマナリーベース>

6,771,500

<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	5,552,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,535,900
日銀当座預金残高増減前日比	+16,800

<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		-400
財政等要因		-6,500
資金過不足		-6,900
金融調節		
CP等買入	期落	新規
		-400
国債補完供給	+24,000	-26,600
金融調節合計		-3,000
当座預金増減-②		-9,900

<6月27日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,526,000
準備預金残高	4,918,300
積み終了先	4,917,000
超過準備	4,916,900
非準備先残高	607,700

<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)	1,300
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	40.0
進捗率乖離幅	+59.9

<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		-100
財政等要因		-3,400
資金過不足		-3,500
金融調節確定分		
CP等買入	期落	新規
		-3,000 +3,000
国債補完供給	+26,600	
金融調節合計		+26,600
当座預金増減		+23,100

<6月28日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残554兆9,100億円)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	5,594,100	+68,100
+40,000	5,589,100	+63,100
+35,000	5,584,100	+58,100
+30,000	5,579,100	+53,100
+25,000	5,574,100	+48,100
+20,000	5,569,100	+43,100
+15,000	5,564,100	+38,100
+10,000	5,559,100	+33,100
+5,000	5,554,100	+28,100
± 0	5,549,100	+23,100
-5,000	5,544,100	+18,100
-10,000	5,539,100	+13,100
-15,000	5,534,100	+8,100
-20,000	5,529,100	+3,100
-25,000	5,524,100	-1,900
-30,000	5,519,100	-6,900
-35,000	5,514,100	-11,900
-40,000	5,509,100	-16,900
-45,000	5,504,100	-21,900

<6月27日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 6/27-24/ 6/28	応札 27,315億 落札 27,315億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 6/27-24/ 6/28	応札 0億 落札 0億

<6月27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
9,922.6	61,434	成長基盤強化支援資金供給	1,001
6/26~7/10 8,005.	6/25(1-3Y) 3,751.	貸出増加支援資金供給	8/19~8/19 381.
1/6~1/6 20,014.	6/25(3-5Y) 4,253.	国債買入額(月初来)	11/18~11/18 93.
1/5~1/6 10,016.	6/25(5-10Y) 4,255.	9/2~9/2 1,804.	2/17~2/17 346.
1/10~1/10 20,011.		12/2~12/2 1,712.	5/17~5/12 0.
1/13~1/14 20,008.		3/3~3/3 6,793.	5/12~5/12 181.
1/16~1/16 20,009.		6/2~6/2 2,644.	8/18~8/18 0.
1/19~1/20 1,163.		9/1~9/1 5,024.	11/17~11/17 0.
		12/1~12/1 2,464.	2/16~2/16 0.
		3/2~3/2 7,922.	
		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.	
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売先(米ドルオペ用担保)	
		0	
		国庫短期証券買入額(月初来)	
		0	
		国債売先先オペ	
		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	
		CP買入額(月初来)	
		3,000	
		6/14 3,000.	
		(6/28 2,995.)	
		社債買入額(月初来)	
		750	
		6/21 750.	
		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	
		共通担保(全)固定	99,226
		CP等買入(推定)	20,600
		共通担保(全)金入	70,035
		社債等買入(推定)	58,300
		国債買入先	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	790,646
		国債売先先	0
		供給オペ合計	1,069,647
		国債補完供給	27,315
		貸出(推定)	0
		国売先(米ドル担保)	0
		供給額合計	1,069,647
		吸収額合計	27,315
		差し引き	1,042,332

※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買入	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N +0.070	1M +0.180000	3M 買気配 +0.050
1W 売気配 +0.070	2M +0.270000	6M 買気配 +0.100
2W 売気配 +0.070	3M -----	1Y 買気配 +0.200
1M 売気配 +0.070		

<6月26日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	117,424	-1,784
有担保	37,680	+99
無担保	79,744	-1,883

<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	0.070	0.079	0.077	± 0				-----	0.026	-0.056
トムネ				-----				-----	-0.061	-0.113
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.027	-0.023
2週間物			0.170	-0.024				-----	0.038	-0.014
3週間物				-----				-----	0.044	-0.008
1ヶ月物	0.180	0.190	0.181	-----				-----	0.047	-0.005
3ヶ月物			0.210	-0.040				-----	0.084	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.139	± 0
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