東京短資デイリーレポート　2024/6/28

＜6月27日のマネタリーベース＞

6,762,000

＜6月28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	5,549,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,526,000
日銀当座預金残高増減前日比	+23,100

＜6月28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		-200
財政等要因		-9,200
資金過不足		-9,400
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-3,000	+3,000
国債補完供給	+26,600	-25,400
金融調節合計		+1,200
当座預金増減-②		-8,200

＜6月28日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高（①+②）	5,517,800
準備預金残高	4,905,300
積み終了先	4,905,200
超過準備	4,905,100
非準預先残高	612,500

＜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）	700
残り要積立額（平均）	0
準預進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	50.0
進捗率乖離幅	+49.9

＜7月1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		+500
財政等要因		-14,600
資金過不足		-14,100
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+6,700
国債補完供給	+25,400	
金融調節合計		+32,100
当座預金増減		+18,000

＜7月1日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残553兆5,800億円)で
無担保コールO/Nは+0.075%～+0.080%
での出合いが中心か。

＜7月1日9時20分のオペによる日銀当座預金状況＞

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,580,800	+63,000
+40,000	5,575,800	+58,000
+35,000	5,570,800	+53,000
+30,000	5,565,800	+48,000
+25,000	5,560,800	+43,000
+20,000	5,555,800	+38,000
+15,000	5,550,800	+33,000
+10,000	5,545,800	+28,000
+5,000	5,540,800	+23,000
± 0	5,535,800	+18,000
-5,000	5,530,800	+13,000
-10,000	5,525,800	+8,000
-15,000	5,520,800	+3,000
-20,000	5,515,800	-2,000
-25,000	5,510,800	-7,000
-30,000	5,505,800	-12,000
-35,000	5,500,800	-17,000
-40,000	5,495,800	-22,000
-45,000	5,490,800	-27,000

＜6月28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。

(10:10)	国債買入(3Y-5Y)	24/ 7/ 1	4,250億	応札	7,656億	落札	4,252億	最低	+0.001%	平均	+0.003%	按分 100.0%
(10:10)	国債買入(10Y-25Y)	24/ 7/ 1	1,500億	応札	2,719億	落札	1,506億	最低	0.000%	平均	+0.004%	按分 14.5%
(10:10)	国債買入(25Y-)	24/ 7/ 1	750億	応札	1,394億	落札	752億	最低	+0.004%	平均	+0.007%	按分 47.1%
(10:10)	国債買入(物国)	24/ 7/ 1	600億	応札	1,550億	落札	600億	按分	-0.370円	平均	-0.519円	
(11:50)	国債補完供給	24/ 6/28-24/ 7/ 1		応札	25,907億	落札	25,907億	全取	-0.350%	平均	-0.350%	
(13:50)	国債補完供給	24/ 6/28-24/ 7/ 1		応札	246億	落札	246億	全取	-0.350%	平均	-0.350%	

＜6月28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
99,226

6/26~ 7/10	8,005.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.
1/10~ 1/10	20,011.
1/13~ 1/14	20,008.
1/16~ 1/16	20,009.
1/19~ 1/20	1,163.

国債買入額(月初来)
61,434

6/25(1-3Y)	3,751.
6/25(3-5Y)	4,253.
6/25(5-10Y)	4,255.
(7/ 1(3-5Y)	4,252.)
(7/ 1(10-25Y)	1,506.)
(7/ 1(25Y-)	752.)
(7/ 1(物国)	600.)

貸出支援基金の運営として行うオペレーション

成長基盤強化支援資金供給
31,523

9/ 2~ 9/ 2	1,804.
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.

※直近約1年分の期落ち分を記載

貸出増加支援資金供給
868,658

9/16~ 9/13	132,310.
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

被災地金融機関支援資金供給
1,001

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.

米ドル資金供給オペ
0百万ﾄﾞﾙ

6/27~ 7/ 5	0.

成長基盤強化支援米ドル特則
16,122百万ﾄﾞﾙ

9/ 5~ 9/ 5	5,382.
12/ 4~12/ 4	3,325.
3/ 4~ 3/ 4	2,097.
6/ 3~ 6/ 3	5,318.

気候変動対応支援資金供給
81,666

7/21~ 7/19	34,398.
1/30~ 1/30	47,268.

共通担保(全店)金利入札
70,035

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.

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

※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

※直近約1週間の実施分を記載

国債補完供給
26,153

6/28~ 7/ 1	25,907.
6/28~ 7/ 1	246.

ＣＰ買入額(月初来)
5,995

6/14	3,000.
6/28	2,995.

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.

社債買入額(月初来)
750

6/21	750.

＜6月28日 日銀信用概算(除く買切)＞

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	790,646	国債売現先	0
供給オペ合計	1,069,647	国債補完供給	26,153
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	1,069,647	吸収額合計	26,153
差し引き	1,043,494		

※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28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	------	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	------	1Y	買気配 +0.200
1M	売気配 +0.070				

＜6月27日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)＞

	残高	増減
市場合計	116,685	-739
有担保	37,508	-172
無担保	79,177	-567

＜6月28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	0.060	0.079	0.076	-0.001				------	0.028	+0.002
トムネ				------				------	0.047	+0.108
スポネ				------				------		
1週間物				------				------	0.049	+0.022
2週間物			0.150	-0.020				------	0.049	+0.011
3週間物				------				------	0.049	+0.005
1ヶ月物	0.190	0.270	0.212	+0.031				------	0.051	+0.004
3ヶ月物				------				------	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