

東京短資デイリーレポート

2023/6/5

<6月2日のマナリーベース>

6,593,700

<6月5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	5,378,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,336,200
日銀当座預金残高増減前日比	+42,700

<6月5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		-4,600
資金過不足		-3,900
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+12,300
CP等買入	-300	
国債補完供給	+34,100	-34,100
金融調節合計		+12,000
当座預金増減-②		+8,100

<6月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,344,300
準備預金残高	4,652,300
積み終了先	4,651,900
超過準備	4,651,900
非準備先残高	692,000

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,008,700
今積み期間所要準備額(平均)	129,300
残り要積立額(積数)	2,700
残り要積立額(平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	67.7
進捗率乖離幅	+32.2

<6月6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		+1,100
財政等要因		-4,200
資金過不足		-3,100
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-400	
社債等買入	-400	
国債補完供給	+34,100	
金融調節合計		+33,300
当座預金増減		+30,200

<6月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残537兆4,500億円)で 無担保コール0/Nは-0.070%~-0.060% での出合いが中心か。
--

<6月6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	5,419,500	+75,200
+40,000	5,414,500	+70,200
+35,000	5,409,500	+65,200
+30,000	5,404,500	+60,200
+25,000	5,399,500	+55,200
+20,000	5,394,500	+50,200
+15,000	5,389,500	+45,200
+10,000	5,384,500	+40,200
+5,000	5,379,500	+35,200
±0	5,374,500	+30,200
-5,000	5,369,500	+25,200
-10,000	5,364,500	+20,200
-15,000	5,359,500	+15,200
-20,000	5,354,500	+10,200
-25,000	5,349,500	+5,200
-30,000	5,344,500	+200
-35,000	5,339,500	-4,800
-40,000	5,334,500	-9,800
-45,000	5,329,500	-14,800

<6月5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(国)(5Y-10Y)	23/ 6/ 6	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.090%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 6/ 6	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.295%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 6/ 6	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.265%
(11:50) 国債補完供給	23/ 6/ 5-23/ 6/ 6	応札	33,926億	落札	33,926億	全取	-0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/ 6/ 5-23/ 6/ 6	応札	84億	落札	84億	全取	-0.350% 平均 -0.350%

<6月5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	98,936	国債買入額(月初末)	12,263	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	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
							1,001
5/24~ 6/ 7	7,715.	5/30(3-5Y)	5,000.	47,883	722,786	8/20~ 8/18	0.
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	5/30(5-10Y)	5,762.	9/ 3~ 9/ 1	1,940.	6/19~ 6/19	28,033.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	5/30(10-25Y)	2,008.	9/ 4~ 9/ 4	34.	9/17~ 9/15	13,014.
1/10~ 1/10	20,011.	5/30(25Y-)	1,005.	12/ 4~12/ 4	10,258.	12/16~12/15	20,601.
1/13~ 1/14	20,008.	5/30(物国)	601.	3/ 4~ 3/ 4	2,178.	3/18~ 3/18	41,458.
1/16~ 1/16	20,009.	6/ 5(-1Y)	1,500.	6/ 3~ 6/ 3	1,950.	※直近約1年分の期落ち分を記載	
1/19~ 1/20	1,163.	6/ 5(1-3Y)	4,252.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	米ドル資金供給オペ	0百万ドル
		6/ 5(3-5Y)	4,505.	12/ 2~12/ 2	1,712.	6/ 1~ 6/ 8	0.
		6/ 5(10-25Y)	2,006.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	※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	
						17,427百万ドル	
						9/ 2~ 9/ 5	6,101.
						12/ 2~12/ 4	3,607.
						3/ 3~ 3/ 4	2,153.
						6/ 2~ 6/ 3	5,566.
						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
						国債買入額(固定利回)(月初末)	0
						国債買入額	0
						CP買入額(月初末)	0
						社債買入額(月初末)	0
						貸出増加支援	650,943
						手形売出	0
						貸出オペ合計	926,180
						国債補完供給	34,010
						貸出(推定)	0
						国債売現先	0
						供給額合計	926,180
						吸収額合計	34,010
						差し引き	892,170

※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5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	0.000	1M	-----	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.100
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.100
1M	売気配 -0.020				

<6月2日のコール市場残高(単位:億円)>

		残高	増減
市場合計	190,756	+2,214	
有担保	24,727	+1,741	
無担保	166,029	+473	

<6月5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	-0.087	0.001	-0.068	+0.004					-0.098	+0.004
トムネ									-0.102	+0.014
スポネ										
1週間物	-0.070	-0.030	-0.062	-0.002					-0.132	+0.006
2週間物	-0.065	0.030	-0.047						-0.140	+0.004
3週間物									-0.148	+0.004
1ヶ月物			0.005	-0.245					-0.175	-0.001
3ヶ月物									-0.161	+0.001
6ヶ月物									-0.134	±0
1年物									-0.102	±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