東京短資デイリーレポート　2023/6/21

＜6月20日のマネタリーベース＞

6,777,100

＜6月21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	5,550,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,519,500
日銀当座預金残高増減前日比	+30,500

＜6月21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		-8,700
資金過不足		-9,400
金融調節		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,900
CP等買入	-200	
国債補完供給	+36,200	-37,400
金融調節合計		-500
当座預金増減-②		-9,900

＜6月21日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高 (①+②)	5,509,600
準備預金残高	4,841,900
積み終了先	4,838,300
超過準備	4,837,300
非準預先残高	667,700

＜参考＞

今積み期間所要準備額（積数）	3,883,300
今積み期間所要準備額（平均）	129,400
残り要積立額（積数）	23,900
残り要積立額（平均）	1,000
準預進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	20.0
進捗率乖離幅	+79.3

＜6月22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		-900
財政等要因		+6,900
資金過不足		+6,000
金融調節確定分		
	期落	新規
国庫短期証券買入		+1,000
CP等買入	-300	
社債等買入		+1,000
国債補完供給	+37,400	
金融調節合計		+39,100
当座預金増減		+45,100

＜6月22日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残555兆4,700億円)で
無担保コール0/Nは-0.080%～-0.070%
での出合いが中心か。

＜6月22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	5,599,700	+90,100
+40,000	5,594,700	+85,100
+35,000	5,589,700	+80,100
+30,000	5,584,700	+75,100
+25,000	5,579,700	+70,100
+20,000	5,574,700	+65,100
+15,000	5,569,700	+60,100
+10,000	5,564,700	+55,100
+5,000	5,559,700	+50,100
± 0	5,554,700	+45,100
-5,000	5,549,700	+40,100
-10,000	5,544,700	+35,100
-15,000	5,539,700	+30,100
-20,000	5,534,700	+25,100
-25,000	5,529,700	+20,100
-30,000	5,524,700	+15,100
-35,000	5,519,700	+10,100
-40,000	5,514,700	+5,100
-45,000	5,509,700	+100

＜6月21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(固)(5Y-10Y)	23/ 6/22		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.115%
(10:10)	国債買入(固)(5Y-10Y)	23/ 6/22		応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.295%
(10:10)	国庫短期証券買	23/ 6/22	1,000億	応札	8,516億	落札	1,001億	最低 +0.016% 平均	+0.016% 按分 76.6%
(11:50)	国債補完供給	23/ 6/21-23/ 6/22		応札	37,273億	落札	37,273億	全取 -0.350% 平均	-0.351%
(13:50)	国債補完供給	23/ 6/21-23/ 6/22		応札	167億	落札	167億	全取 -0.350% 平均	-0.350%

＜6月21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
１００，１３１
6/21~ 7/ 5 8,910.
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)
４０，８０８
6/16(1-3Y) 4,254.
6/16(5-10Y) 5,755.
6/16(10-25Y) 2,003.
6/16(25Y-) 1,007.

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
４７，８８３
9/ 3~ 9/ 1 1,940.
9/ 4~ 9/ 4 34.
12/ 4~12/ 4 10,258.
3/ 4~ 3/ 4 2,178.
6/ 3~ 6/ 3 1,950.
9/ 2~ 9/ 2 1,804.
12/ 2~12/ 2 1,712.
3/ 3~ 3/ 3 6,793.
※直近約1年分の期落ち分を記載

貸出増加支援資金供給
７５４，２１２
9/17~ 9/15 13,014.
12/16~12/15 20,601.
3/18~ 3/18 41,458.
6/19~ 6/19 63,179.
※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
8/20~ 8/18 0.
11/19~11/17 0.
2/18~ 2/16 0.
5/17~ 5/17 0.
8/19~ 8/19 381.
11/18~11/18 93.
2/17~ 2/17 346.
5/12~ 5/12 181.

米ドル資金供給オペ
１百万ﾄﾞﾙ
6/15~ 6/22 1.
(6/22~ 6/29 1.)

成長基盤強化支援米ドル特則
１７，４２７百万ﾄﾞﾙ
9/ 2~ 9/ 5 6,101.
12/ 2~12/ 4 3,607.
3/ 3~ 3/ 4 2,153.
6/ 2~ 6/ 3 5,566.

国債売現先(米ドルオペ用担保)
2
6/14~ 6/23 2.

国庫短期証券買入額(月初来)

国債売現先オペ
２，００３
6/ 7 1,001.
6/14 1,002.
(6/22 1,001.)

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

共通担保(全店)金利入札
４０，０２１
1/24~ 1/24 10,003.
2/ 1~ 2/ 1 10,004.
2/15~ 2/15 10,004.
3/ 1~ 3/ 1 10,010.

国債補完供給
３７，４４０
6/21~ 6/22 37,273.
6/21~ 6/22 167.

ETF買入額
３５６，２２０
約定 23/ 3/14 701.

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

ＣＰ買入額(月初来)
３，９９６
6/13 3,996.

社債買入額(月初来)
0
(6/22 1,002.)

新型コロナ企業金融支援
５１，９４１
3/31~ 6/30 51,941.

気候変動対応支援資金供給
４４，２１４
7/21~ 7/21 15,953.
1/30~ 1/30 28,261.

＜6月21日 日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	100,131	CP等買入(推定)	24,800
共通担保(全)金入	40,021	社債等買入(推定)	72,500
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	44,214		
成長基盤支援	43,417		
貸出増加支援	683,578	手形売出	0
新型コロナ企業金融支援	51,941	国債売現先	0
供給オペ合計	964,303	国債補完供給	37,440
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	2
供給額合計	964,303	吸収額合計	37,442
	差し引き	926,861	

※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21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 -0.030
1M	売気配 -0.020				

＜6月20日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)＞

	残高	増減
市場合計	176,656	+2,270
有担保	27,930	+1,201
無担保	148,726	+1,069

＜6月21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	-0.072	-0.003				------	-0.089	-0.001
トムネ				------				------	-0.091	± 0
スポネ				------				------		
1週間物	-0.075	-0.040	-0.062	-0.002				------	-0.108	+0.004
2週間物				------				------	-0.147	+0.007
3週間物				------				------	-0.144	+0.007
1ヶ月物				------				------	-0.145	+0.003
3ヶ月物			0.023	------				------	-0.153	+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