

東京短資デイリーレポート

2024/6/3

<5月31日のマネタリーベース>

6,757,200

<6月3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	5,488,600
前日の日銀当座預金残高-①	5,515,300
日銀当座預金残高増減前日比	-26,700

<6月3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		+900
財政等要因		-67,700
資金過不足		-66,800
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+10,900
社債等買入	-100	
国債補完供給	+27,800	-28,600
成長基盤強化支援	-1,600	
金融調節合計		+8,400
当座預金増減-②		-58,400

<6月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,456,900
準備預金残高	4,823,600
積み終了先	4,822,600
超過準備	4,822,600
非準備先残高	633,300

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,079,800
今積み期間所要準備額 (平均)	131,600
残り要積立額 (積数)	2,300
残り要積立額 (平均)	200
準備進捗率 (%)	99.9
日数進捗率 (%)	61.3
進捗率乖離幅	+38.6

<6月4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		-36,800
資金過不足		-35,900
金融調節確定分		
	期落	新規
国債補完供給	+28,600	
金融調節合計		+28,600
当座預金増減		-7,300

<6月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残544兆9,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での出合いが中心か。
--

<6月4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	5,494,600	+37,700
+40,000	5,489,600	+32,700
+35,000	5,484,600	+27,700
+30,000	5,479,600	+22,700
+25,000	5,474,600	+17,700
+20,000	5,469,600	+12,700
+15,000	5,464,600	+7,700
+10,000	5,459,600	+2,700
+5,000	5,454,600	-2,300
± 0	5,449,600	-7,300
-5,000	5,444,600	-12,300
-10,000	5,439,600	-17,300
-15,000	5,434,600	-22,300
-20,000	5,429,600	-27,300
-25,000	5,424,600	-32,300
-30,000	5,419,600	-37,300
-35,000	5,414,600	-42,300
-40,000	5,409,600	-47,300
-45,000	5,404,600	-52,300

<6月3日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	24/ 6/ 3-24/ 6/ 4	応札 29,555億 落札 29,555億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 6/ 3-24/ 6/ 4	応札 0億 落札 0億

<6月3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			
98,380		11,372		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		1,001	
5/29~ 6/12	7,159.	6/ 3(3-5Y)	4,256.	3 1,5 2 3	8 6 4, 1 9 1	8/19~ 8/19	381.		
1/ 6~ 1/ 6	20,014.	6/ 3(5-10Y)	4,257.	9/ 2~ 9/ 2	1,804.	6/19~ 6/19	63,179.	11/18~11/18	93.
1/ 5~ 1/ 6	10,016.	6/ 3(10-25Y)	1,504.	12/ 2~12/ 2	1,712.	9/16~ 9/13	132,310.	2/17~ 2/17	346.
1/10~ 1/10	20,011.	6/ 3(25Y-)	754.	3/ 3~ 3/ 3	6,793.	12/15~12/13	54,701.	5/17~ 5/12	0.
1/13~ 1/14	20,008.	6/ 3(物国)	601.	6/ 2~ 6/ 2	2,644.	3/17~ 3/17	64,498.	5/12~ 5/12	181.
1/16~ 1/16	20,009.			9/ 1~ 9/ 1	5,024.			8/18~ 8/18	0.
1/19~ 1/20	1,163.			12/ 1~12/ 1	2,464.			11/17~11/17	0.
				3/ 2~ 3/ 2	7,922.	※直近約1年分の期落ち分を記載		2/16~ 2/16	0.
				6/ 3~ 6/ 3	3,160.	米ドル資金供給オペ			
						0百万ドル			
						5/30~ 6/ 6	0.		
						※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			
						1 6, 1 2 2百万ドル			
						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			
						国債補完供給			
						29,555			
						6/ 3~ 6/ 4	29,555.		
						6/ 3~ 6/ 4	0.		
						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.		
						CP買入額(月初来)			
						0			
						社債買入額(月初来)			
						0			
						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			
						26,761	手形売出		0
						貸出増加支援	782,979	国債売現先	0
						供給オペ合計	1,060,819	国債補完供給	29,555
						貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
						供給額合計	1,060,819	吸収額合計	29,555
						差し引き	1,031,264		

※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3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	+0.170000	3M	買気配 +0.050
1W	売気配 +0.070	2M	+0.140000	6M	買気配 +0.150
2W	売気配 +0.070	3M	-----	1Y	買気配 +0.250
1M	売気配 +0.070				

<5月31日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	121,602	+5,847
有担保	38,278	-1,193
無担保	83,324	+7,040

<6月3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	0.078	0.077	± 0				-----	0.086	+0.068
トムネ				-----				-----	0.069	-0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.059	+0.003
2週間物			0.150	-0.020				-----	0.059	+0.001
3週間物				-----				-----	0.059	+0.002
1ヶ月物			0.230	+0.010				-----	0.058	+0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.086	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.130	+0.003
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