

東京短資デイリーレポート

2024/6/18

<6月17日のマネタリーベース>

6,718,800

<6月18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	5,522,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,483,000
日銀当座預金残高増減前日比	+39,000

<6月18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		+5,500
資金過不足		+6,200
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補充供給	+31,400	-31,600
金融調節合計		-300
当座預金増減-②		+5,900

<6月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,488,900
準備預金残高	4,854,800
積み終了先	4,828,700
超過準備	4,811,100
非準備先残高	634,100

<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)	31,200
残り要積立額(平均)	1,200
準備進捗率(%)	99.2
日数進捗率(%)	10.0
進捗率乖離幅	+89.2

<6月19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		-400
財政等要因		+100
資金過不足		-300
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+13,500
国債補充供給	+31,600	
貸出増加支援	-60,000	+67,600
金融調節合計		+52,700
当座預金増減		+52,400

<6月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残554兆1,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.075%~+0.080% での合いが中心か。

<6月19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	5,586,300	+97,400
+40,000	5,581,300	+92,400
+35,000	5,576,300	+87,400
+30,000	5,571,300	+82,400
+25,000	5,566,300	+77,400
+20,000	5,561,300	+72,400
+15,000	5,556,300	+67,400
+10,000	5,551,300	+62,400
+5,000	5,546,300	+57,400
±0	5,541,300	+52,400
-5,000	5,536,300	+47,400
-10,000	5,531,300	+42,400
-15,000	5,526,300	+37,400
-20,000	5,521,300	+32,400
-25,000	5,516,300	+27,400
-30,000	5,511,300	+22,400
-35,000	5,506,300	+17,400
-40,000	5,501,300	+12,400
-45,000	5,496,300	+7,400

<6月18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(1Y-3Y)	24/ 6/19	3,750億 応札 8,851億 落札 3,751億 最低 -0.007% 平均 +0.001% 按分 4.0%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	24/ 6/19	4,250億 応札 8,968億 落札 4,253億 最低 0.000% 平均 +0.002% 按分 52.2%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	24/ 6/19	4,250億 応札 11,996億 落札 4,256億 最低 +0.012% 平均 +0.014% 按分 35.4%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	24/ 6/19	1,500億 応札 3,627億 落札 1,502億 最低 +0.037% 平均 +0.041% 按分 98.8%
(10:40) 社債買入	24/ 6/21	750億 応札 1,531億 落札 750億 最低 +0.503% 平均 +0.518% 按分 52.9%
(10:40) ミドル資金供給	24/ 6/21-24/ 6/27	応札 1ml 落札 1ml 貸付 5.580%
(11:50) 国債補充供給	24/ 6/18-24/ 6/19	応札 32,318億 落札 32,318億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補充供給	24/ 6/18-24/ 6/19	応札 0億 落札 0億

<6月18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	国債買入額(月初末)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
99,227	35,413	成長基盤強化支援資金供給	1,001	1,001
6/12~ 6/26 8,006.	6/13(1-3Y) 3,752.	31,523	864,191	8/19~ 8/19 381.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	6/13(3-5Y) 4,252.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	6/19~ 6/19 63,179.	11/18~11/18 93.
1/ 5~ 1/ 6 20,016.	6/13(5-10Y) 4,262.	12/ 2~12/ 2 1,712.	9/16~ 9/13 132,310.	2/17~ 2/17 346.
1/10~ 1/10 20,011.	6/13(25Y-) 752.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	12/15~12/13 54,701.	5/17~ 5/12 0.
1/13~ 1/14 20,008.	(6/19(1-3Y) 3,751.)	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	3/17~ 3/17 64,498.	5/12~ 5/12 181.
1/16~ 1/16 20,009.	(6/19(3-5Y) 4,253.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	※直近約1年分の期落ち分を記載	8/18~ 8/18 0.
1/19~ 1/20 1,163.	(6/19(5-10Y) 4,256.)	12/ 1~12/ 1 2,464.	米ドル資金供給オペ	11/17~11/17 0.
	(6/19(10-25Y) 1,502.)	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	0百万ドル	2/16~ 2/16 0.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/13~ 6/21 0.	
			(6/21~ 6/27 1.)	
		※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(月初末)		
		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)(月初末)		
		0		
		国債補充供給		
		32,318		
		6/18~ 6/19 32,318.		
		6/18~ 6/19 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		
		CP買入額(月初末)		
		3,000		
		6/14 3,000.		
		社債買入額(月初末)		
		0		
		(6/21 750.)		
		<6月18日 日銀信用概算(除く買切)>		
		共通担保(全)固定 99,227	CP等買入(推定) 21,800	
		共通担保(全)金入 70,035	社債等買入(推定) 58,700	
		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 782,979	国債売現先 0	
		供給オペ合計 1,061,981	国債補充供給 32,318	
		貸出(推定) 0	国債売現先(米ドル担保) 0	
		供給額合計 1,061,981	吸収額合計 32,318	
		差し引き 1,029,663		

※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18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 +0.125000	3M 買気配 +0.100
1W 売気配 +0.070	2M +0.149000	6M 買気配 +0.100
2W 売気配 +0.070	3M +0.230000	1Y 買気配 +0.220
1M 売気配 +0.070		

<6月17日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,391	+4,881
有担保	39,348	+584
無担保	81,043	+4,297

<6月18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	0.040	0.080	0.077	±0					0.072	-0.001
トムネ				-----					0.045	-0.011
スポネ				-----						
1週間物			0.125	-0.025					0.045	-0.004
2週間物				-----					0.044	±0
3週間物				-----					0.045	-0.001
1ヶ月物	0.195	0.230	0.222	-0.014					0.042	-0.002
3ヶ月物	0.190	0.210	0.197	-----					0.083	-0.002
6ヶ月物				-----					0.137	+0.001
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