

東京短資デイリーレポート

2024/6/26

<6月25日のマネタリーベース>

6,790,000

<6月26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	5,563,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,554,500
日銀当座預金残高増減前日比	+8,700

<6月26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		-100
財政等要因		-21,200
資金過不足		-21,300
金融調節		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
CP等買入	-200	
国債補完供給	+26,900	-24,000
金融調節合計		+2,700
当座預金増減-②		-18,600

<6月26日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,535,900
準備預金残高	4,937,000
積み終了先	4,935,700
超過準備	4,935,700
非準備先残高	598,900

<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)	2,700
残り要積立額 (平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	36.7
進捗率乖離幅	+63.2

<6月27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		-6,400
資金過不足		-6,800
金融調節確定分		
	期落	新規
CP等買入	-400	
国債補完供給	+24,000	
金融調節合計		+23,600
当座預金増減		+16,800

<6月27日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残555兆2,700億円)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27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	5,597,700	+61,800
+40,000	5,592,700	+56,800
+35,000	5,587,700	+51,800
+30,000	5,582,700	+46,800
+25,000	5,577,700	+41,800
+20,000	5,572,700	+36,800
+15,000	5,567,700	+31,800
+10,000	5,562,700	+26,800
+5,000	5,557,700	+21,800
±0	5,552,700	+16,800
-5,000	5,547,700	+11,800
-10,000	5,542,700	+6,800
-15,000	5,537,700	+1,800
-20,000	5,532,700	-3,200
-25,000	5,527,700	-8,200
-30,000	5,522,700	-13,200
-35,000	5,517,700	-18,200
-40,000	5,512,700	-23,200
-45,000	5,507,700	-28,200

<6月26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。

(11:50) 国債補完供給	24/ 6/26-24/ 6/27	応札 24,534億 落札 24,534億 全取 -0.150% 平均 -0.150%
(13:50) 国債補完供給	24/ 6/26-24/ 6/27	応札 0億 落札 0億

<6月26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
9 9,226	6 1,434	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
6/26~ 7/10 8,005.	6/19(1-3Y) 3,751.	3 1,523	8 68,658
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	6/19(3-5Y) 4,253.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	6/19(5-10Y) 4,256.	12/ 2~ 12/ 2 1,712.	12/15~ 12/13 54,701.
1/10~ 1/10 20,011.	6/19(10-25Y) 1,502.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
1/13~ 1/14 20,008.	6/25(1-3Y) 3,751.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/18~ 6/18 26,498.
1/16~ 1/16 20,009.	6/25(3-5Y) 4,253.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/16~ 9/13 132,310.
1/19~ 1/20 1,163.	6/25(5-10Y) 4,255.	12/ 1~ 12/ 1 2,464.	12/15~ 12/13 54,701.
		3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/17~ 3/17 64,498.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 26,498.
			6/21~ 6/27 1.
			6/27~ 7/ 5 0.)
			※直近約1年分の期落ち分を記載
			※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 6,122百万ドル
			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
			国債売現先オペ
			0
			国債買入額(固定利回)(月初来)
			0
			国債補完供給
			2 4,534
			6/26~ 6/27 24,534.
			6/26~ 6/27 0.
			ETF買入額
			3 56,921
			約定 23/10/ 4 701.
			ETF買入額(企業支援)
			1 4,628
			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
			C P買入額(月初来)
			3,000
			6/14 3,000.
			(6/28 2,995.)
			社債買入額(月初来)
			7 50
			6/21 750.
			<6月26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) 21,000
			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 24,534
			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 24,534
			差し引き 1,045,113

※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26日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先			CPプライマリ			TBアウトライト		
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	最低	最高	平均
	+0.070		0.077	+0.200000		0.200	3M	買気配 +0.050	
1W	売気配 +0.070			+0.150000			6M	買気配 +0.100	
2W	売気配 +0.070			+0.259000			1Y	買気配 +0.200	
1M	売気配 +0.070								

<6月25日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	119,208	-5,290
有担保	37,581	-167
無担保	81,627	-5,123

<6月26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	0.079	0.077	-0.001					0.082	+0.005
トムネ				-----					0.052	-0.032
スポネ				-----						
1週間物				-----					0.050	-0.001
2週間物	0.180	0.200	0.194	-----					0.052	±0
3週間物			0.200	-----					0.052	±0
1ヶ月物				-----					0.052	±0
3ヶ月物			0.250	-----					0.084	±0
6ヶ月物			0.370	-0.030					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