

東京短資デイリーレポート

2025/6/4

<6月3日のマネタリーベース>

6,438,800

<6月4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	5,177,800
前日の日銀当座預金残高-①	5,220,400
日銀当座預金残高増減前日比	-42,600

<6月4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		+600
財政等要因		-33,800
資金過不足		-33,200
金融調節		
	期落	新規
社債等買入	-300	
国債補完供給	+1,800	-1,600
金融調節合計		-100
当座預金増減-②		-33,300

<6月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,187,100
準備預金残高	4,711,100
積み終了先	4,710,600
超過準備	4,710,600
非準備先残高	476,000

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,107,900
今積み期間所要準備額 (平均)	132,500
残り要積立額 (積数)	2,700
残り要積立額 (平均)	200
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	64.5
進捗率乖離幅	+35.4

<6月5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		+1,500
資金過不足		+1,900
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+7,800
国債補完供給	+1,600	
金融調節合計		+9,400
当座預金増減		+11,300

<6月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残519兆8,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での合いが中心か。

<6月5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	5,243,400	+56,300
+40,000	5,238,400	+51,300
+35,000	5,233,400	+46,300
+30,000	5,228,400	+41,300
+25,000	5,223,400	+36,300
+20,000	5,218,400	+31,300
+15,000	5,213,400	+26,300
+10,000	5,208,400	+21,300
+5,000	5,203,400	+16,300
± 0	5,198,400	+11,300
-5,000	5,193,400	+6,300
-10,000	5,188,400	+1,300
-15,000	5,183,400	-3,700
-20,000	5,178,400	-8,700
-25,000	5,173,400	-13,700
-30,000	5,168,400	-18,700
-35,000	5,163,400	-23,700
-40,000	5,158,400	-28,700
-45,000	5,153,400	-33,700

<6月4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)	25/ 6/ 5	1,000億 応札 4,795億 落札 1,000億 全取 +0.020% 平均 +0.021%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	25/ 6/ 5	2,750億 応札 5,778億 落札 2,752億 最低 +0.010% 平均 +0.012% 按分 54.8%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	25/ 6/ 5	2,750億 応札 8,809億 落札 2,756億 最低 +0.012% 平均 +0.015% 按分 24.4%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 6/ 5	1,350億 応札 3,831億 落札 1,351億 最低 +0.021% 平均 +0.023% 按分 51.6%
(11:50) 国債補完供給	25/ 6/ 4-25/ 6/ 5	応札 1,626億 落札 1,626億 全取 +0.250% 平均 +0.250%
(13:50) 国債補完供給	25/ 6/ 4-25/ 6/ 5	応札 0億 落札 0億

<6月4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
8,005	0	成長基盤強化支援資金供給	336
5/28~ 6/11 8,005.	5/30(3-5Y) 2,753. 5/30(5-10Y) 3,003. 5/30(10-25Y) 1,353. 5/30(物国) 500. (6/ 5(-1Y) 1,000.) (6/ 5(1-3Y) 2,752.) (6/ 5(3-5Y) 2,756.) (6/ 5(10-25Y) 1,351.)	18,570 791,136 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 6/18~ 6/18 26,498. 6/19~ 6/18 67,646. 9/15~ 9/12 27,659. 9/13~ 9/12 121,454. 12/15~12/15 20,129. 12/13~12/15 33,838. 3/16~ 3/16 38,879. 3/17~ 3/16 18,695. ※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則 米ドル資金供給オペ 5,717百万ドル 0百万ドル 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 5/29~ 6/ 5 0. (6/ 5~ 6/12 0.) 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 2,384. 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) 国債売現先オペ 0 C P買入額(月初来) 0 社債買入額(月初来) 0	8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/18~11/17 57. 11/17~11/17 0. 2/16~ 2/16 0. 2/17~ 2/16 0. 5/12~ 5/12 0. 気候変動対応支援資金供給 142,065 7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 69,704.
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.			
国債補完供給	1,626		
6/ 4~ 6/ 5 1,626. 6/ 4~ 6/ 5 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.			

※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4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 売気配 +0.400	1M売気配 +0.5050Q03M	買気配 +0.450
1W 売気配 +0.400	2M売気配 +0.5400Q06M	買気配 +0.500
2W 売気配 +0.400	3M -----	1Y 買気配 +0.600
1M 売気配 +0.400		

<6月3日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	114,668	-655
有担保	30,962	-308
無担保	83,706	-347

<6月4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	0.450	0.478	0.477	± 0			0.430	± 0	0.495	-0.002
トムネ				-----				-----	0.492	-0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.482	0.610	0.517	+0.007				-----	0.479	± 0
2週間物				-----				-----	0.477	± 0
3週間物				-----				-----	0.475	+0.001
1ヶ月物			0.550	+0.010				-----	0.475	± 0
3ヶ月物				-----				-----	0.484	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.500	± 0
1年物				-----				-----	0.572	± 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