

# 東京短資デイリーレポート

2025/2/18

## <2月17日のマネタリーベース>

6,518,800
-----------

## <2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	5,273,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,276,900
日銀当座預金残高増減前日比	-3,500

## <2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		+1,000
財政等要因		-6,900
資金過不足		-5,900
金融調節		
国債補完供給	期落	新規
	+2,600	-3,300
金融調節合計		-700
当座預金増減-②		-6,600

## <2月18日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,270,300
準備預金残高	4,762,900
積み終了先	4,747,700
超過準備	4,721,300
非準備先残高	507,400

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,681,900
今積み期間所要準備額(平均)	131,500
残り要積立額(積数)	46,200
残り要積立額(平均)	1,800
準備進捗率(%)	98.7
日数進捗率(%)	10.7
進捗率乖離幅	+88.0

## <2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		-100
財政等要因		-4,000
資金過不足		-4,100
金融調節確定分		
共通担保(全店)	期落	新規
	-8,000	+8,000
国債補完供給		+3,300
金融調節合計		+3,300
当座預金増減		-800

## <2月19日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残526兆9,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での合いが中心か。
---

## <2月19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	5,314,500	+44,200
+40,000	5,309,500	+39,200
+35,000	5,304,500	+34,200
+30,000	5,299,500	+29,200
+25,000	5,294,500	+24,200
+20,000	5,289,500	+19,200
+15,000	5,284,500	+14,200
+10,000	5,279,500	+9,200
+5,000	5,274,500	+4,200
± 0	5,269,500	-800
-5,000	5,264,500	-5,800
-10,000	5,259,500	-10,800
-15,000	5,254,500	-15,800
-20,000	5,249,500	-20,800
-25,000	5,244,500	-25,800
-30,000	5,239,500	-30,800
-35,000	5,234,500	-35,800
-40,000	5,229,500	-40,800
-45,000	5,224,500	-45,800

## <2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。

(10:40) 米ドル資金供給	25/ 2/20-25/ 2/27	応札	2m1l 落札	2m1l	貸付	4.580%
(11:50) 国債補完供給	25/ 2/18-25/ 2/19	応札	3,473億	落札	3,473億	全取 +0.150% 平均 +0.149%
(13:00) 共通担保(全)固	25/ 2/19-25/ 3/ 5	8,000億	応札	13,673億	落札	8,009億 貸付 0.500% 按分 58.6%
(13:50) 国債補完供給	25/ 2/18-25/ 2/19		応札	0億	落札	0億
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	25/ 2/19-25/ 2/28	5,000億	応札	2億	落札	2億 全取 +0.470% 平均 +0.470%

## <2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)	貸出支援基金の運用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	
8,007	26,780	成長基盤強化支援資金供給	517	
2/ 5~ 2/19 8,007. (2/19~ 3/ 5 8,009.)	2/14(1-3Y) 3,001. 2/14(5-10Y) 3,255. 2/14(10-25Y) 1,503. 2/14(25Y-) 750.	28,007	512~ 5/12 181. 5/17~ 5/12 0. 8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/17~11/17 0. 11/18~11/17 57. 2/16~ 2/16 0. 2/17~ 2/16 0.	
共通担保(全店)金利入札		※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	
70,035		成長基盤強化支援米ドル特別	米ドル資金供給オペ	
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.		9,918百万ドル	5百万ドル	
国債補完供給		3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842.	2/14~ 2/20 5. (2/20~ 2/27 2.)	気候変動対応支援資金供給
3,473		国債買現先オペ	142,065	
2/18~ 2/19 3,473. 2/18~ 2/19 0.		0	7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 69,704.	
ETF買入額		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
356,921		2		
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)		2/13~ 2/21 2. (2/19~ 2/28 2.)		
14,628		国債短期証券買入額(月初末)		
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額		0		
6,823		※直近約1週間の実施分を記載		
約定 22/ 6/14 12.		国債買入額(固定利回)(月初末)		
		0		
		CP買入額(月初末)		
		0		
		社債買入額(月初末)		
		0		

## <2月18日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	8,007	CP等買入(推定)	15,600
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	49,700
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	517		
気候変動対応支援	142,065		
成長基盤支援	24,018	手形売出	0
貸出増加支援	771,475	国債売現先	0
供給オペ合計	1,016,117	国債補完供給	3,473
貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	2
供給額合計	1,016,117	吸収額合計	3,475
		差し引き	1,012,642

※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。

## <2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 +0.400	1M +0.520000	3M 買気配 +0.350
1W 売気配 +0.400	2M -----	6M 買気配 +0.450
2W 売気配 +0.400	3M +0.610000	1Y 買気配 +0.600
1M 売気配 +0.400		

## <2月17日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,015	-467
有担保	39,416	-248
無担保	80,599	-219

## <2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	0.450	0.525	0.477	± 0			0.430	± 0	0.459	-0.020
トムネ				-----				-----	0.448	+0.007
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.550	-0.084				-----	0.421	+0.002
2週間物			0.550	+0.072				-----	0.423	+0.003
3週間物				-----				-----	0.421	-0.001
1ヶ月物				-----				-----	0.423	-0.005
3ヶ月物				-----				-----	0.449	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.486	+0.002
1年物				-----				-----	0.554	± 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