東京短資デイリーレポート

2025/2/19

<2月18日のマネタリーベース>

6,511,300

<2月19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	5,269,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,270,300
日銀当座預金残高増減前日比	-800

<2月19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		-900
資金過不足		-1,000
金融調節		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+3,300	-3,200
金融調節合計		+100
当座預金増減-②		-900

<2月19日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,269,400
準備預金残高	4,792,000
積み終了先	4,777,300
超過準備	4,776,700
非準備先残高	477,400

<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)	30,900
残り要積立額(平均)	1,300
準備進捗率(%)	99.1
日数進捗率(%)	14.3
進捗率乖離幅	+84.8

<2月20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		+500
財政等要因		+27,300
資金過不足		+27,800
金融調節確定分		
国債買入		+9,700
CP等買入	-200	
国債補完供給	+3,200	
金融調節合計		+12,700
当座預金増減		+40,500

<2月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残530兆9,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での合いが中心か。

<2月20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	5,354,900	+85,500
+40,000	5,349,900	+80,500
+35,000	5,344,900	+75,500
+30,000	5,339,900	+70,500
+25,000	5,334,900	+65,500
+20,000	5,329,900	+60,500
+15,000	5,324,900	+55,500
+10,000	5,319,900	+50,500
+5,000	5,314,900	+45,500
±0	5,309,900	+40,500
-5,000	5,304,900	+35,500
-10,000	5,299,900	+30,500
-15,000	5,294,900	+25,500
-20,000	5,289,900	+20,500
-25,000	5,284,900	+15,500
-30,000	5,279,900	+10,500
-35,000	5,274,900	+5,500
-40,000	5,269,900	+500
-45,000	5,264,900	-4,500

<2月19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)	25/ 2/20	3,000億	応札 6,275億	落札 3,001億	最低 -0.007%	平均 -0.004%	按分 65.8%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	25/ 2/20	3,000億	応札 8,352億	落札 3,008億	最低 -0.014%	平均 -0.013%	按分 56.9%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 2/20	3,250億	応札 5,939億	落札 3,254億	最低 -0.014%	平均 -0.009%	按分 65.4%
(10:10) 国債買入(25Y-)	25/ 2/20	750億	応札 1,662億	落札 750億	最低 -0.003%	平均 +0.002%	按分 60.0%
(11:50) 国債補完供給	25/ 2/19-25/ 2/20		応札 3,442億	落札 3,442億	全取 +0.150%	平均 +0.150%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 2/19-25/ 2/20		応札 0億	落札 0億			

<2月19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)	成長基盤強化支援米ドル特別	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
8,009	26,780				517
2/19~ 3/ 5	8,009.	2/14(1-3Y) 3,001.	28,007	836,939	5/12~ 5/12 181.
		2/14(5-10Y) 3,255.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
		2/14(10-25Y) 1,503.	3/ 4~ 3/ 4 2,097.	6/18~ 6/18 26,498.	8/19~ 8/18 279.
		2/14(25Y-) 750.	2/14(25Y-) 750.	6/19~ 6/18 67,646.	8/18~ 8/18 0.
		(2/20(1-3Y) 3,001.)	6/ 3~ 6/ 3 5,318.	9/15~ 9/12 27,659.	11/17~11/17 0.
		(2/20(3-5Y) 3,008.)	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/13~ 9/12 121,454.	11/18~11/17 57.
		(2/20(5-10Y) 3,254.)	9/ 5~ 9/ 5 1,661.	12/15~12/15 20,129.	2/16~ 2/16 0.
		(2/20(25Y-) 750.)	12/ 1~12/ 1 2,464.	12/13~12/15 33,838.	2/17~ 2/16 0.
			12/ 4~12/ 4 842.	3/16~ 3/16 38,879.	
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.		9,918百万ドル		5百万ドル	
2/ 1~ 2/ 1 10,004.		3/ 4~ 3/ 4 2,097.		2/14~ 2/20 5.	
2/15~ 2/15 10,004.		6/ 3~ 6/ 3 5,318.		(2/20~ 2/27 2.)	
3/ 1~ 3/ 1 10,010.		9/ 5~ 9/ 5 1,661.		気候変動対応支援資金供給	
9/15~ 9/15 10,005.		12/ 4~12/ 4 842.		142,065	
10/10~10/10 10,006.		国債買入先オペ		7/19~ 7/18 72,361.	
10/25~10/25 10,003.		0		1/30~ 1/30 69,704.	
国債補完供給		0		国債売先(米ドルオペ用担保)	
3,442		C P買入額(月初末)		4	
2/19~ 2/20 3,442.		0		2/13~ 2/21 2.	
2/19~ 2/20 0.		0		2/19~ 2/28 2.	
ETF買入額		0		国庫短期証券買入額(月初末)	
356,921		0		0	
約定 23/10/ 4 701.		0		0	
ETF買入額(企業支援)		0		0	
14,628		0		0	
約定 21/ 3/31 12.		0		0	
J-REIT買入額		0		0	
6,823		0		0	
約定 22/ 6/14 12.		0		0	
ETF買入額		0		0	
356,921		0		0	
約定 23/10/ 4 701.		0		0	
ETF買入額(企業支援)		0		0	
14,628		0		0	
約定 21/ 3/31 12.		0		0	
J-REIT買入額		0		0	
6,823		0		0	
約定 22/ 6/14 12.		0		0	

※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19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	-----	1Y	買気配 +0.600
1M	売気配 +0.400				

<2月18日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,379	+364
有担保	37,464	-1,952
無担保	82,915	+2,316

<2月19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	0.489	+0.030
トムネ				-----				-----	0.474	+0.026
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.483	0.550	0.535	-0.015				-----	0.433	+0.012
2週間物				-----				-----	0.425	+0.002
3週間物				-----				-----	0.425	+0.004
1ヶ月物				-----				-----	0.428	+0.005
3ヶ月物			0.615	-----				-----	0.450	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.487	+0.001
1年物				-----				-----	0.560	+0.006

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