

東京短資デイリーレポート

2025/2/26

<2月25日のマネタリーベース>

6,559,600

<2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	5,322,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,318,700
日銀当座預金残高増減前日比	+3,700

<2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		+300
財政等要因		-7,200
資金過不足		-6,900
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+4,500	-5,000
金融調節合計		-500
当座預金増減-②		-7,400

<2月26日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,311,300
準備預金残高	4,835,600
積み終了先	4,834,600
超過準備	4,834,400
非準備先残高	475,700

<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)	5,100
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	39.3
進捗率乖離幅	+60.5

<2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		+1,900
資金過不足		+1,500
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+8,200
CP等買入		-100
国債補完供給	+5,000	
金融調節合計		+13,100
当座預金増減		+14,600

<2月27日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残532兆5,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%～+0.477% での出合いが中心か。
--

<2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	5,370,900	+59,600
+40,000	5,365,900	+54,600
+35,000	5,360,900	+49,600
+30,000	5,355,900	+44,600
+25,000	5,350,900	+39,600
+20,000	5,345,900	+34,600
+15,000	5,340,900	+29,600
+10,000	5,335,900	+24,600
+5,000	5,330,900	+19,600
± 0	5,325,900	+14,600
-5,000	5,320,900	+9,600
-10,000	5,315,900	+4,600
-15,000	5,310,900	-400
-20,000	5,305,900	-5,400
-25,000	5,300,900	-10,400
-30,000	5,295,900	-15,400
-35,000	5,290,900	-20,400
-40,000	5,285,900	-25,400
-45,000	5,280,900	-30,400

<2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。

(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	25/ 2/27	3,000億	応札 12,627億	落札 3,005億	最低 -0.029%	平均 -0.027%	按分 15.3%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 2/27	3,250億	応札 9,005億	落札 3,256億	最低 -0.038%	平均 -0.037%	按分 75.8%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 2/27	1,500億	応札 2,615億	落札 1,501億	最低 -0.048%	平均 -0.042%	按分 100.0%
(10:10) 国債買入(物国)	25/ 2/27	500億	応札 1,964億	落札 500億	按分 -0.160円	平均 -0.220円	按分 4.0%
(11:50) 国債補完供給	25/ 2/26-25/ 2/27		応札 5,183億	落札 5,183億	全取 +0.250%	平均 +0.250%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 2/26-25/ 2/27		応札 0億	落札 0億			

(9:30) 成長基盤(米ドル特則)	25/ 3/ 4-26/ 3/ 4	830mil	先数 8先
---------------------	-------------------	--------	-------

<2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 8,009		国債買入額(月初来) 36,793		貸出支援基金の運営として行うオペレーション 成長基盤強化支援資金供給 28,007		被災地金融機関支援資金供給 貸出増加支援資金供給 836,939		517	
2/19~ 3/ 5 8,009.		2/20(1-3Y) 3,001. 2/20(3-5Y) 3,008. 2/20(5-10Y) 3,254. 2/20(25Y-) 750. (2/27(3-5Y) 3,005.) (2/27(5-10Y) 3,256.) (2/27(10-25Y) 1,501.) (2/27(物国) 500.)		3/ 3~ 3/ 3 6,793. 3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/ 4~12/ 4 842.		3/17~ 3/17 64,498. 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.		5/12~ 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.	
				※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 9,918百万ドル		※直近約1年分の期落ち分を記載 米ドル資金供給オペ 2百万ドル			
共通担保(全店)金利入札 70,035				3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842. (3/ 4~ 3/ 4 830.) 国債買現先オペ 0		2/20~ 2/27 2. (2/27~ 3/ 6 0.)		気候変動対応支援資金供給 142,065	
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.								7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 69,704.	
						国債売現先(米ドルオペ用担保) 2 2/19~ 2/28 2. 国庫短期証券買入額(月初来) 0			
		※直近約1週間の実施分を記載 国債買入額(固定利回)(月初来) 0							
国債補完供給 5,183				C P買入額(月初来) 0					
2/26~ 2/27 5,183. 2/26~ 2/27 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.				社債買入額(月初来) 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26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	+0.550000	3M	買気配 +0.350
1W	売気配 +0.400	2M	+0.524000	6M	買気配 +0.450
2W	売気配 +0.400	3M	+0.600000	1Y	買気配 +0.650
1M	売気配 +0.400				

<2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	0.450	0.525	0.477	-0.002			0.430	± 0	0.476	-0.016
トムネ				-----				-----	0.474	-0.017
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.500	0.550	0.527	-0.024				-----	0.444	-0.001
2週間物				-----				-----	0.442	+0.001
3週間物			0.550	-0.010				-----	0.439	± 0
1ヶ月物	0.529	0.600	0.543	-----				-----	0.435	± 0
3ヶ月物			0.585	-----				-----	0.456	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.492	+0.003
1年物				-----				-----	0.580	+0.003

<2月25日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	122,758	+4,057
有担保	37,803	+906
無担保	84,955	+3,151

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