# 東京短資デイリーレポート

2025/2/28

## <u><2月27日のマネタリーベース></u>

6,559,500

## <2月28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	5,333,500
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	+14,800

# <2月28日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

~2万20日の日数日注及並省機安田し並機制助/									
_ 資金需給実績									
	銀行券要因		+400						
ш	財政等要因			+800					
ш	資金過不足			+1,200					
	金融調節								
		期	落	新規					
ш	CP等買入		-500						
ш	社債等買入		-200						
ш	国債補完供給	+6	,300	-12,900					
	金融調節合計			-7,300					
	当座預金増減-②			-6 100					

#### <2月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,312,600
準備預金残高	4,814,600
積み終了先	4,813,800
超過準備	4,813,800
非準預先残高	498,000

## <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)	1,600
残り要積立額(平均)	100
準預進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	53.6
進捗率乖離幅	+46.3

## <3月3日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

		貧金需給予想 (1)			
		銀行券要因	+500		
		財政等要因			-36,700
		資金過不足			-36,200
	-	金融調節確定分			
			期落		新規
		国債補完供給	+12	,900	
		成長基盤強化支援	-6	,700	
		金融調節合計			+6,200
L		当座預金増減			-30,000

## <3月3日のオペ予想>

<u> &lt;3月3日の4 ヘア忠&gt;</u>
朝一の金融調節はノーオペ
(当預残528兆2,600億円)で
無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477%
での出合いが中心か。

#### <3月3日9時20分のオペによる日銀当座預金状況)

(3月3日9時20分の	カオペによる日	眼当座預金状况
9時20分の	日銀当座	前日比
オペ	預金残高	増減
+45,000	5,327,600	+15,000
+40,000	5,322,600	+10,000
+35,000	5,317,600	+5,000
+30,000	5,312,600	± 0
+25,000	5,307,600	-5,000
+20,000	5,302,600	-10,000
+15,000	5,297,600	-15,000
+10,000	5,292,600	-20,000
+5,000	5,287,600	-25,000
± 0	5,282,600	-30,000
-5,000	5,277,600	-35,000
-10,000	5,272,600	-40,000
-15,000	5,267,600	-45,000
-20,000	5,262,600	-50,000
-25,000	5,257,600	-55,000
-30,000	5,252,600	-60,000
-35,000	5,247,600	-65,000
-40,000	5,242,600	-70,000
-45,000	5,237,600	-75,000

2月28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。詳細は弊社中をご参照ください。

	(11:50) 国債補完供給	25/ 2/28-25/ 3/ 3	応札 12,532億 落札 12,434億 全取 +0.150% 平均 +0.150%
	(13:50) 国債補完供給	25/ 2/28-25/ 3/ 3	応札 1,460億 落札 1,460億 全取 +0.150% 平均 +0.141%
7			
1			
1			
1			
_			
í			
╛			

**<2月28日 各才ペ残高と内訳>** (カッコ内は先日付スタート・#印はエンドが13時同時処理)

<2月28日 各才ペ残器	<b>らと内訳&gt;</b> (カッコ内は	先日付スタート・#印はエン	ドが13時同時処理)	<del></del>
共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初来)		して行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給
8,009	45,055	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	517
2/19~ 3/ 5 8,009.	2/27(3-5Y) 3,005.	28,007	836,939	5/12~ 5/12 181.
	2/27(5-10Y) 3,256.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.	5/17~ 5/12 0.
	2/27(10-25Y) 1,501.	3/ 4~ 3/ 4 2,097.		' '
	2/27(物国) 500.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.		
	-/(12)	6/ 3~ 6/ 3 5,318.		11/17~11/17 0.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		
		, , ,		2/16~ 2/16 0.
		, , ,		
		, , ,		2/17~ 2/16 0.
		12/ 4~12/ 4 842.	3/16~ 3/16 38,879.	
			※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	0 百万ドル	
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	2/27~ 3/ 6 0.	気候変動対応支援資金供給
共通担保(全店)金利入札		6/ 3~ 6/ 3 5,318.		142,065
70,035		9/5~9/5 1,661.		7/19~ 7/18 72,361.
1/24~ 1/24 10,003.		12/ 4~12/ 4 842.		1/30~ 1/30 69,704.
2/ 1~ 2/ 1 10,004.		(3/4~3/4 830.)		
2/15~ 2/15 10,004.		国債買現先オペ	1	
3/ 1~ 3/ 1 10,010.		0	国債売現先(米ドルオペ用担保)	
9/15~ 9/15 10,005.		<u> </u>	0	
			0	
10/25~10/25 10,003.				
			国庫短期証券買入額(月初来)	
		国債売現先オペ	0	
	※直近約1週間の実施分を記載	0		
	国債買入額(固定利回)(月初来)			
	0			
国債補完供給				
13,894				
2/28~ 3/ 3 12,434.		C P 買入額(月初来)		
2/28~ 3/ 3 1,460.		0		
		-	<b>&lt;2月28日 日銀信用</b>	概算(除く買切)>
				CP等買入(推定) 14,500
				社債等買入(推定) 49,300
ETF買入額	1		国債買現先 0	
356.921			被災地金融機関支援 517	4
約定 23/10/4 701.		社債買入額(月初来)	気候変動対応支援 142.065	
ETF買入額(企業支援)			成長基盤支援 24,018	
	1	0		
14,628			貸出増加支援 771,475	
約定 21/ 3/31 12.			供給オペ合計 1,016,119	
J-REIT買入額				国売現(米ドル担保) 0
6,823			供給額合計 1,016,119	
約定 22/ 6/14 12.	※直近約1週間の実施分を記載		差し引き	1,002,225
※成長其般路(	レ士怪姿を併給のタオペけ	貸付口,返落期口が同じせ	<b>豊</b> 会まとめて表示しています	<i>‡</i>

※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28日のオープン市場気配レート(単位:%)>**

~~	340HW3 77	יומי יווי	<u>X(比レード(干)</u>	4.41	/				
	NCD/CP現先	C	アプライマリ	TE	3アウトライト	_	<2月27日の	コール市場残高(	単位:億円)
S/N	+0.400	1M		3M	買気配 +0.350			残高	増減
1W	売気配 +0.400	2M		6M	買気配 +0.450		市場合計	123,947	+3,184
2W	売気配 +0.400	3M	+0.590000	1Y	買気配 +0.650		有担保	37,646	-631
1M	売気配 +0.400						無担保	86.301	+3.815

<2月28日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

<b>~2/720</b> H	<u> </u>										
		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	0.479	0.477	± 0			0.430	± 0	0.401	-0.077	
トムネ									0.465	+0.026	
スポネ											
1週間物									0.441	± 0	
2週間物	0.640	0.650	0.645	+0.115					0.439	± 0	
3週間物									0.435	-0.002	
1ヶ月物			0.600	+0.033					0.432	-0.002	
3ヶ月物	0.620	0.700	0.640	± 0					0.458	± 0	
6ヶ月物									0.494	+0.001	
1年物	·								0.588	+0.002	

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