

# 東京短資デイリーレポート

2025/8/5

## <8月4日のマナリーベース>

6,419,500
-----------

## <8月5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	5,209,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,200,600
日銀当座預金残高増減前日比	+8,600

## <8月5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		+2,600
資金過不足		+3,200
金融調節		
国債補完供給	+3,600	-3,000
金融調節合計		+600
当座預金増減-②		+3,800

## <8月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,204,400
準備預金残高	4,710,000
積み終了先	4,709,900
超過準備	4,709,900
非準備先残高	494,400

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,121,200
今積み期間所要準備額 (平均)	132,900
残り要積立額 (積数)	200
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	67.7
進捗率乖離幅	+32.2

## <8月6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		-26,200
資金過不足		-26,300
金融調節確定分		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+3,000	
金融調節合計		+3,000
当座預金増減		-23,300

## <8月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残518兆1,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。
---

## <8月6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	5,226,100	+21,700
+40,000	5,221,100	+16,700
+35,000	5,216,100	+11,700
+30,000	5,211,100	+6,700
+25,000	5,206,100	+1,700
+20,000	5,201,100	-3,300
+15,000	5,196,100	-8,300
+10,000	5,191,100	-13,300
+5,000	5,186,100	-18,300
± 0	5,181,100	-23,300
-5,000	5,176,100	-28,300
-10,000	5,171,100	-33,300
-15,000	5,166,100	-38,300
-20,000	5,161,100	-43,300
-25,000	5,156,100	-48,300
-30,000	5,151,100	-53,300
-35,000	5,146,100	-58,300
-40,000	5,141,100	-63,300
-45,000	5,136,100	-68,300

## <8月5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/ 8/ 7-25/ 8/14	応札	2ml 落札	2ml	貸付	4.570%	
(11:50) 国債補完供給	25/ 8/ 5-25/ 8/ 6	応札	3,039億 落札	3,039億	全取	+0.250% 平均 +0.250%	
(13:00) 共通担保(全)国	25/ 8/ 6-25/ 8/20	8,000億	応札	16,895億 落札	8,005億	貸付	0.500% 按分 47.4%
(13:50) 国債補完供給	25/ 8/ 5-25/ 8/ 6		応札	200億 落札	200億	全取	+0.250% 平均 +0.250%

## <8月5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	
8,009	0	成長基盤強化支援資金供給	336	
7/23~ 8/ 6 8,009. (8/ 6~ 8/20 8,005.)	7/29(5-10Y) 3,505. 7/29(10-25Y) 1,351. 7/29(25Y-) 751. 7/29(物国) 500.	18,570 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 3,160. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	767,180 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. 6/18~ 6/18 70,188. 6/20~ 6/19 46,265.	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.
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.		5,717百万ドル	0百万ドル	
国債補完供給		9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	7/31~ 8/ 7 0. (8/ 7~ 8/14 2.)	気候変動対応支援資金供給
3,239		国債買現先オペ	171,298	
8/ 5~ 8/ 6 3,039. 8/ 5~ 8/ 6 200.		0	1/30~ 1/30 69,704. 7/18~ 7/21 101,594.	
ETF買入額		国債売現先オペ		
356,921		0		
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)		国債売現先オペ(米ドルオペ用担保)		
14,628		0		
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額		国庫短期証券買入額(月初来)		
6,823		0		
約定 22/ 6/14 12.		0		
		※直近約1週間の実施分を記載		
		CP買入額(月初来)		
		0		
		社債買入額(月初来)		
		0		

## <8月5日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	8,009	CP等買入(推定)	6,400
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	37,700
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	336		
気候変動対応支援	171,298		
成長基盤支援	15,225	手形売出	0
貸出増加支援	710,030	国債売現先	0
供給オペ合計	974,933	国債補完供給	3,239
貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
供給額合計	974,933	吸収額合計	3,239
		差し引き	971,694

※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。

## <8月5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 -----	3M 買気配 +0.500
1W	売気配 +0.400	2M +0.540000	6M 買気配 +0.600
2W	売気配 +0.400	3M +0.609000	1Y 買気配 +0.700
1M	売気配 +0.400		

## <8月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	110,177	-3,203
有担保	31,074	-3,069
無担保	79,103	-134

## <8月5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	0.600	0.477	+0.001			0.430	± 0	0.490	-0.006
トムネ				-----				-----	0.492	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.481	0.550	0.503	-0.042				-----	0.482	± 0
2週間物				-----				-----	0.482	± 0
3週間物				-----				-----	0.481	± 0
1ヶ月物			0.620	+0.090				-----	0.483	+0.001
3ヶ月物	0.595	0.700	0.616	+0.028				-----	0.497	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.529	± 0
1年物				-----				-----	0.609	-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