

東京短資デイリーレポート

2025/8/14

<8月13日のマネタリーベース>

6,389,400

<8月14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	5,146,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,169,900
日銀当座預金残高増減前日比	-23,400

<8月14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		-700
財政等要因		-22,300
資金過不足		-23,000
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-200	
社債等買入	-200	
国債補完供給	+600	-500
金融調節合計		-300
当座預金増減-②		-23,300

<8月14日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,146,600
準備預金残高	4,701,500
積み終了先	4,701,500
超過準備	4,701,500
非準備先残高	445,100

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,113,100
今積み期間所要準備額 (平均)	132,700
残り要積立額 (積数)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	96.8
進捗率乖離幅	+3.2

<8月15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		+700
財政等要因		+76,200
資金過不足		+76,900
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+8,500
国債補完供給	+500	
金融調節合計		+9,000
当座預金増減		+85,900

<8月15日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残523兆2,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<8月15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	5,277,500	+130,900
+40,000	5,272,500	+125,900
+35,000	5,267,500	+120,900
+30,000	5,262,500	+115,900
+25,000	5,257,500	+110,900
+20,000	5,252,500	+105,900
+15,000	5,247,500	+100,900
+10,000	5,242,500	+95,900
+5,000	5,237,500	+90,900
± 0	5,232,500	+85,900
-5,000	5,227,500	+80,900
-10,000	5,222,500	+75,900
-15,000	5,217,500	+70,900
-20,000	5,212,500	+65,900
-25,000	5,207,500	+60,900
-30,000	5,202,500	+55,900
-35,000	5,197,500	+50,900
-40,000	5,192,500	+45,900
-45,000	5,187,500	+40,900

<8月14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/ 8/15	3,250億	応札 10,408億	落札 3,253億	最低 +0.021%	平均 +0.021%	按分 98.6%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 8/15	3,500億	応札 9,322億	落札 3,500億	全取 +0.014%	平均 +0.014%	
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 8/15	1,350億	応札 4,697億	落札 1,354億	最低 -0.002%	平均 +0.001%	按分 45.4%
(10:10) 国債買入(25Y-)	25/ 8/15	750億	応札 1,645億	落札 751億	最低 -0.022%	平均 -0.013%	按分 28.0%
(11:50) 国債補完供給	25/ 8/14-25/ 8/15		応札 640億	落札 640億	全取 +0.250%	平均 +0.250%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 8/14-25/ 8/15		応札 0億	落札 0億			

(9:30) 被災地金融機関支援	25/ 8/18-26/ 8/18	130億					貸付 0.000%
-------------------	-------------------	------	--	--	--	--	-----------

<8月14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
8,005	8,859	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	336
8/ 6~ 8/20 8,005.	8/ 7(-1Y) 1,000.	1 8,570	7 67,180	8/18~ 8/18 0.
	8/ 7(1-3Y) 3,253.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/15~ 9/12 27,659.	8/19~ 8/18 279.
	8/ 7(3-5Y) 3,254.	9/ 5~ 9/ 5 1,661.	9/13~ 9/12 121,454.	11/18-11/17 57.
	8/ 7(10-25Y) 1,352.	12/ 1-12/ 1 2,464.	12/15-12/15 20,129.	11/17-11/17 0.
	(8/15(1-3Y) 3,253.)	12/ 4-12/ 4 842.	12/13-12/15 33,838.	2/16~ 2/16 0.
	(8/15(5-10Y) 3,500.)	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/16~ 3/16 38,879.	2/17~ 2/16 0.
	(8/15(10-25Y) 1,354.)	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.	5/12~ 5/12 0.
	(8/15(25Y-) 751.)	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 70,188.	(8/18~ 8/18 130.)
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/20~ 6/19 46,265.	

※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	
成長基盤強化支援米ドル特別	米ドル資金供給オペ	5,717百万ドル	1百万ドル
9/ 5~ 9/ 5 1,661.	8/14~ 8/21 1.	9/ 5~ 9/ 5 1,661.	8/14~ 8/21 1.
12/ 4-12/ 4 842.	3/ 4~ 3/ 4 830.	12/ 4-12/ 4 842.	3/ 4~ 3/ 4 830.
3/ 4~ 3/ 4 830.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	3/ 4~ 3/ 4 830.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.
6/ 3~ 6/ 3 2,384.		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	

共通担保(全店)金利入札	70,035	国債買入先オペ	0
1/24~ 1/24 10,003.	2/ 15~ 2/15 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.	

国債買入先オペ	0	国債売先オペ(米ドルオペ用担保)	2
8/13~ 8/22 2.		国債売先オペ	0
CP買入額(月初末)	0	社債買入額(月初末)	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.			

※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14日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	売気配	1M	CPプライマリ	3M	TBアウトライト	買気配
1W	+0.400	2M	-----	6M	買気配	+0.600
2W	+0.400	3M	+0.610000	1Y	買気配	+0.700
1M	+0.400					

<8月13日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	114,973	-531
有担保	33,574	+264
無担保	81,399	-795

<8月14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	0.487	± 0
トムネ				-----				-----	0.488	-0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.590	+0.106				-----	0.482	± 0
2週間物			0.483	-0.008				-----	0.482	± 0
3週間物				-----				-----	0.482	+0.001
1ヶ月物				-----				-----	0.484	± 0
3ヶ月物			0.700	+0.095				-----	0.499	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.530	± 0
1年物				-----				-----	0.609	± 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