

東京短資デイリーレポート

2025/8/19

<8月18日のマネタリーベース>

6,447,400

<8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	5,225,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,228,200
日銀当座預金残高増減前日比	-3,000

<8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	+600
財政等要因	-3,500
資金過不足	-2,900
金融調節	
国債補完供給	+900
金融調節合計	+400
当座預金増減-②	-2,500

<8月19日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,225,700
準備預金残高	4,778,500
積み終了先	4,763,800
超過準備	4,757,800
非準備先残高	447,200

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,108,500
今積み期間所要準備額 (平均)	132,500
残り要積立額 (積数)	25,200
残り要積立額 (平均)	900
準備進捗率(%)	99.3
日数進捗率(%)	12.9
進捗率乖離幅	+86.4

<8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	-600
財政等要因	-2,900
資金過不足	-3,500
金融調節確定分	
共通担保(全店)	-8,000
国債補完供給	+500
金融調節合計	+500
当座預金増減	-3,000

<8月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残522兆2,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<8月20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	5,267,700	+42,000
+40,000	5,262,700	+37,000
+35,000	5,257,700	+32,000
+30,000	5,252,700	+27,000
+25,000	5,247,700	+22,000
+20,000	5,242,700	+17,000
+15,000	5,237,700	+12,000
+10,000	5,232,700	+7,000
+5,000	5,227,700	+2,000
± 0	5,222,700	-3,000
-5,000	5,217,700	-8,000
-10,000	5,212,700	-13,000
-15,000	5,207,700	-18,000
-20,000	5,202,700	-23,000
-25,000	5,197,700	-28,000
-30,000	5,192,700	-33,000
-35,000	5,187,700	-38,000
-40,000	5,182,700	-43,000
-45,000	5,177,700	-48,000

<8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。

(10:40) 米ドル資金供給	25/ 8/21-25/ 8/28	応札 0m1 落札 0m1	貸付 4.580%
(11:50) 国債補完供給	25/ 8/19-25/ 8/20	応札 627億 落札 627億	全取 +0.250% 平均 +0.250%
(13:00) 共通担保(全)国	25/ 8/20-25/ 9/ 3	8,000億 応札 16,603億 落札 8,005億	貸付 0.500% 按分 48.2%
(13:50) 国債補完供給	25/ 8/19-25/ 8/20	応札 0億 落札 0億	

<8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(月初来)	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	17,717	18,570	767,180	187
8/ 6~ 8/20 8,005. (8/20~ 9/ 3 8,005.)	8/15(1-3Y) 3,253. 8/15(5-10Y) 3,500. 8/15(10-25Y) 1,354. 8/15(25Y-) 751.	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.	9/15~ 9/12 27,659. 9/13~ 9/12 121,454. 12/15~12/15 20,129. 2/17~ 2/16 0. 5/12~ 5/12 0. 8/18~ 8/18 130.	11/17~11/17 0. 11/18~11/17 57. 2/16~ 2/16 0. 2/17~ 2/16 0. 5/12~ 5/12 0. 8/18~ 8/18 130.
共通担保(全店)金利入札	70,035	国債買入額(固定利回)(月初来)	0	0
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.	※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	0
国債補完供給	627	CP買入額(月初来)	0	0
8/19~ 8/20 627. 8/19~ 8/20 0.		社債買入額(月初来)	0	0
ETF買入額	356,921	国債売先(米ドルオペ用担保)	2	2
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	14,628	国債売先(米ドルオペ用担保)	2	2
約定 21/ 3/31 12.		国債短期証券買入額(月初来)	0	0
J-REIT買入額	6,823	国債売先(米ドルオペ用担保)	0	0
約定 22/ 6/14 12.		国債売先(米ドルオペ用担保)	0	0

<8月19日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	8,005	CP等買入(推定)	6,200
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	37,500
国債買入先	0		
被災地金融機関支援	187		
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	国債売先	0
供給オペ合計	974,780	国債補完供給	627
貸出(推定)	0	国債売先(米ドル担保)	2
供給額合計	974,780	吸収額合計	629
		差し引き	974,151

※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プライマリー		TBアウトライト	
S/N 売気配 +0.400	1M +0.600000	3M 買気配 +0.530			
1W 売気配 +0.400	2M -----	6M 買気配 +0.600			
2W 売気配 +0.400	3M -----	1Y 買気配 +0.750			
1M 売気配 +0.400					

<8月18日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	112,935	-1,418
有担保	32,881	-1,297
無担保	80,054	-121

<8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	0.478	0.477	± 0			0.430	± 0	0.493	+0.006
トムネ				-----				-----	0.491	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.484	0.550	0.502	-0.041				-----	0.482	± 0
2週間物				-----				-----	0.482	± 0
3週間物				-----				-----	0.482	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.484	± 0
3ヶ月物			0.625	+0.005				-----	0.503	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.533	+0.001
1年物				-----				-----	0.612	± 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