

東京短資デイリーレポート

2025/8/28

<8月27日のマネタリーベース>

6,454,600

<8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	5,242,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,235,000
日銀当座預金残高増減前日比	+7,500

<8月28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	-200
財政等要因	-4,100
資金過不足	-4,300
金融調節	
国債買入	期落 新規 +8,800
国債補完供給	+1,400 -800
金融調節合計	+9,400
当座預金増減-②	+5,100

<8月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,240,100
準備預金残高	4,798,800
積み終了先	4,798,100
超過準備	4,798,100
非準備先残高	441,300

<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)	4,400
残り要積立額(平均)	200
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+57.9

<8月29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	+200
財政等要因	+2,000
資金過不足	+2,200
金融調節確定分	
社債等買入	期落 新規 -100
国債補完供給	+800
金融調節合計	+700
当座預金増減	+2,900

<8月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残524兆3,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<8月29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	5,288,000	+47,900
+40,000	5,283,000	+42,900
+35,000	5,278,000	+37,900
+30,000	5,273,000	+32,900
+25,000	5,268,000	+27,900
+20,000	5,263,000	+22,900
+15,000	5,258,000	+17,900
+10,000	5,253,000	+12,900
+5,000	5,248,000	+7,900
± 0	5,243,000	+2,900
-5,000	5,238,000	-2,100
-10,000	5,233,000	-7,100
-15,000	5,228,000	-12,100
-20,000	5,223,000	-17,100
-25,000	5,218,000	-22,100
-30,000	5,213,000	-27,100
-35,000	5,208,000	-32,100
-40,000	5,203,000	-37,100
-45,000	5,198,000	-42,100

<8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HPをご参照ください。

(11:50) 国債補完供給	25/ 8/28-25/ 8/29	応札 888億 落札 888億 全取 +0.250% 平均 +0.250%
(13:50) 国債補完供給	25/ 8/28-25/ 8/29	応札 0億 落札 0億

<8月28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
8,005	37,090	成長基盤強化支援資金供給	187
8/20~ 9/ 3 8,005.	8/21(1-3Y) 3,255.	貸出増加支援資金供給	187
	8/21(3-5Y) 3,254.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	11/17~11/17 0.
	8/21(5-10Y) 3,500.	9/ 5~ 9/ 5 1,661.	11/18~11/17 57.
	8/28(3-5Y) 3,253.	12/ 1~12/ 1 2,464.	2/16~ 2/16 0.
	8/28(5-10Y) 3,504.	12/ 4~12/ 4 842.	2/17~ 2/16 0.
	8/28(10-25Y) 1,353.	12/13~12/15 33,838.	5/12~ 5/12 0.
	8/28(25Y-) 754.	3/ 16~ 3/16 38,879.	8/18~ 8/18 130.
	8/28(物国) 500.	3/ 4~ 3/ 4 830.	
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	
		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	
		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	2百万ドル
		9/ 5~ 9/ 5 1,661.	8/28~ 9/ 4 2.
		12/ 4~12/ 4 842.	気候変動対応支援資金供給
		3/ 4~ 3/ 4 830.	171,298
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	1/30~ 1/30 69,704.
			7/18~ 7/21 101,594.
		国債買現先オペ	
		0	
		国債売現先(米ドルオペ用担保)	
		0	
		国債短期証券買入額(月初末)	
		0	
		国債売現先オペ	
		0	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		国債買入額(固定利回)(月初末)	
		0	
		国債補完供給	
		888	
		8/28~ 8/29 888.	
		8/28~ 8/29 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.	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		CP買入額(月初末)	
		0	
		社債買入額(月初末)	
		0	
		国債買現先	
		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	国債売現先 0
		供給オペ合計	
		974,780	国債補完供給 888
		貸出(推定)	
		0	国債売現先 0
		供給額合計	
		974,780	吸収額合計 888
		差し引き	973,892

※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28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	+0.570000	3M	買気配 +0.530
1W	売気配 +0.400	2M	0.000000	6M	買気配 +0.600
2W	売気配 +0.400	3M	+0.647000	1Y	買気配 +0.750
1M	売気配 +0.400				

<8月27日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	119,961	-2,721
有担保	31,658	-113
無担保	88,303	-2,608

<8月28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	0.530	0.478	± 0			0.430	± 0	0.486	-0.002
トムネ				-----				-----	0.432	-0.057
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.530	+0.031				-----	0.468	-0.015
2週間物	0.460	0.470	0.465	-0.032				-----	0.478	-0.004
3週間物				-----				-----	0.481	-0.002
1ヶ月物	0.540	0.545	0.544	-0.008				-----	0.485	-0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.528	+0.004
6ヶ月物				-----				-----	0.564	+0.011
1年物				-----				-----	0.667	+0.006

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