

東京短資デイリーレポート

2025/2/4

<2月3日のマナリーベース>

6,514,500

<2月4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	5,200,500
前日の日銀当座預金残高-①	5,265,500
日銀当座預金残高増減前日比	-65,000

<2月4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	+1,300
財政等要因	-77,900
資金過不足	-76,600
金融調節	
国債買入	期落 新規
	+8,900
国債補完供給	+4,900 -4,900
金融調節合計	+8,900
当座預金増減-②	-67,700

<2月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,197,800
準備預金残高	4,700,800
積み終了先	4,700,000
超過準備	4,700,000
非準備先残高	497,000

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,074,100
今積み期間所要準備額(平均)	131,400
残り要積立額(積数)	4,400
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	64.5
進捗率乖離幅	+35.3

<2月5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	-28,000
資金過不足	-27,300
金融調節確定分	
共通担保(全店)	期落 新規
	-8,000 +8,000
国債補完供給	+4,900
金融調節合計	+4,900
当座預金増減	-22,400

<2月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残517兆5,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での合いが中心か。

<2月5日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,220,400	+22,600
+40,000	5,215,400	+17,600
+35,000	5,210,400	+12,600
+30,000	5,205,400	+7,600
+25,000	5,200,400	+2,600
+20,000	5,195,400	-2,400
+15,000	5,190,400	-7,400
+10,000	5,185,400	-12,400
+5,000	5,180,400	-17,400
±0	5,175,400	-22,400
-5,000	5,170,400	-27,400
-10,000	5,165,400	-32,400
-15,000	5,160,400	-37,400
-20,000	5,155,400	-42,400
-25,000	5,150,400	-47,400
-30,000	5,145,400	-52,400
-35,000	5,140,400	-57,400
-40,000	5,135,400	-62,400
-45,000	5,130,400	-67,400

<2月4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/ 2/ 6-25/ 2/14	応札 3m1l 落札 3m1l	貸付 4.580%
(11:50) 国債補完供給	25/ 2/ 4-25/ 2/ 5	応札 5,084億 落札 5,084億 全取 +0.150% 平均 +0.150%	
(13:00) 共通担保(全)固	25/ 2/ 5-25/ 2/19	8,000億 応札 12,348億 落札 8,007億	貸付 0.500% 按分 64.8%
(13:50) 国債補完供給	25/ 2/ 4-25/ 2/ 5	応札 0億 落札 0億	

<2月4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)	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
8,006	9,010	28,007	836,939	863
1/22~ 2/ 5 8,006. (2/ 5~ 2/19 8,007.)	1/29(1-3Y) 3,007. 1/29(3-5Y) 3,010. 1/29(10-25Y) 1,502. 1/31(5-10Y) 3,255. 1/31(25Y-) 753. 1/31(物国) 500. 2/ 4(-1Y) 1,501. 2/ 4(1-3Y) 3,000. 2/ 4(3-5Y) 3,006. 2/ 4(10-25Y) 1,503.	3/ 3~ 3/ 3 6,793. 3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 2~ 6/ 2 2,644. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/ 4~12/ 4 842.	3/17~ 3/17 64,498. 6/18~ 6/18 26,498. 6/19~ 6/18 67,646. 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.	2/17~ 2/17 346. 5/17~ 5/12 0. 5/12~ 5/12 181. 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.
共通担保(全店)金利入札	70,035	9,918百万ドル	2百万ドル	142,065
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.	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.	3/ 4~ 3/ 4 2,097. 6/ 3~ 6/ 3 5,318. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842.	1/30~ 2/ 6 2. (2/ 6~ 2/14 3.)	7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 69,704.
国債補完供給	5,084	0	0	0
2/ 4~ 2/ 5 5,084. 2/ 4~ 2/ 5 0.	2/ 4~ 2/ 5 5,084. 2/ 4~ 2/ 5 0.	0	0	0
ETF買入額	356,921	0	0	0
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	14,628	0	0	0
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額	6,823	0	0	0
約定 22/ 6/14 12.	12.	0	0	0

※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4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	1M	-----	3M	買気配
1W	+0.400	2M	-----	6M	+0.450
2W	+0.400	3M	+0.588000	1Y	+0.450
1M	+0.400				

<2月3日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,869	-3,412
有担保	39,728	-484
無担保	81,141	-2,928

<2月4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	+0.001			0.430	±0	0.454	-0.020
トムネ				-----				-----	0.448	+0.017
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.482	0.550	0.533	-----				-----	0.436	+0.014
2週間物	0.530	0.550	0.545	-----				-----	0.437	+0.015
3週間物				-----				-----	0.437	+0.013
1ヶ月物				-----				-----	0.438	+0.010
3ヶ月物			0.580	-0.090				-----	0.445	+0.003
6ヶ月物				-----				-----	0.477	+0.003
1年物				-----				-----	0.551	±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