

東京短資デイリーレポート

2025/8/20

<8月19日のマネタリーベース>

| |
|-----------|
| 6,444,300 |
|-----------|

<8月20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 | 5,222,700 |
| 前日の日銀当座預金残高① | 5,225,700 |
| 日銀当座預金残高増減前日比 | -3,000 |

<8月20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 | | -3,100 |
| 資金過不足 | | -3,800 |
| 金融調節 | | |
| 共通担保(全店) | -8,000 | +8,000 |
| 国債補充供給 | +500 | -200 |
| 金融調節合計 | | +300 |
| 当座預金増減② | | -3,500 |

<8月20日の日銀当座預金状況>

| | |
|-------------|-----------|
| 当座預金残高(①+②) | 5,222,200 |
| 準備預金残高 | 4,773,300 |
| 積み終了先 | 4,769,100 |
| 超過準備 | 4,768,100 |
| 非準備先残高 | 448,900 |

<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) | 20,000 |
| 残り要積立額(平均) | 800 |
| 準備進捗率(%) | 99.5 |
| 日数進捗率(%) | 16.1 |
| 進捗率乖離幅 | +83.4 |

<8月21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 | | -300 |
| 財政等要因 | | +14,800 |
| 資金過不足 | | +14,500 |
| 金融調節確定分 | | |
| 国債買入 | | +9,900 |
| CP等買入 | -100 | |
| 国債補充供給 | +200 | |
| 金融調節合計 | | +10,000 |
| 当座預金増減 | | +24,500 |

<8月21日のオペ予想>

| |
|---|
| 朝一の金融調節はノーオペ (当預残524兆6,700億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。 |
|---|

<8月21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 | 5,291,700 | +69,500 |
| +40,000 | 5,286,700 | +64,500 |
| +35,000 | 5,281,700 | +59,500 |
| +30,000 | 5,276,700 | +54,500 |
| +25,000 | 5,271,700 | +49,500 |
| +20,000 | 5,266,700 | +44,500 |
| +15,000 | 5,261,700 | +39,500 |
| +10,000 | 5,256,700 | +34,500 |
| +5,000 | 5,251,700 | +29,500 |
| ±0 | 5,246,700 | +24,500 |
| -5,000 | 5,241,700 | +19,500 |
| -10,000 | 5,236,700 | +14,500 |
| -15,000 | 5,231,700 | +9,500 |
| -20,000 | 5,226,700 | +4,500 |
| -25,000 | 5,221,700 | -500 |
| -30,000 | 5,216,700 | -5,500 |
| -35,000 | 5,211,700 | -10,500 |
| -40,000 | 5,206,700 | -15,500 |
| -45,000 | 5,201,700 | -20,500 |

<8月20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/ 8/21 | 3,250億 応札 8,549億 落札 3,255億 | 最低 +0.008% 平均 +0.010% 按分 52.8% |
| (10:10) 国債買入(3Y-5Y) | 25/ 8/21 | 3,250億 応札 9,363億 落札 3,254億 | 最低 +0.008% 平均 +0.008% 按分 89.1% |
| (10:10) 国債買入(5Y-10Y) | 25/ 8/21 | 3,500億 応札 9,873億 落札 3,500億 | 全取 +0.008% 平均 +0.008% |
| (11:50) 国債補充供給 | 25/ 8/20-25/ 8/21 | 応札 308億 落札 308億 | 全取 +0.250% 平均 +0.250% |
| (13:50) 国債補充供給 | 25/ 8/20-25/ 8/21 | 応札 0億 落札 0億 | |

<8月20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 | 17,717 | 成長基盤強化支援資金供給 | 貸出増加支援資金供給 |
| 8/20~ 9/ 3 | 8,005. | 18,570 | 767,180 |
| 8/15(1-3Y) | 3,253. | 9/ 1~ 9/ 1 | 5,024. |
| 8/15(5-10Y) | 3,500. | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| 8/15(10-25Y) | 1,354. | 8/15(25Y-) | 751. |
| (8/21(1-3Y) | 3,255.) | 12/ 1~12/ 1 | 2,464. |
| (8/21(3-5Y) | 3,254.) | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| (8/21(5-10Y) | 3,500.) | 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. |
| | | 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. |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21 | 1. |
| | | (8/21~ 8/28 | 0.) |
| | | 9/ 5~ 9/ 5 | 1,661. |
| | | 12/ 4~12/ 4 | 842. |
| | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. |
| | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. |
| | | 8/14~ 8/21</ | |