

東京短資デイリーレポート

2025/8/27

<8月26日のマネタリーベース>

6,456,700

<8月27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	5,236,000
前日の日銀当座預金残高-①	5,237,400
日銀当座預金残高増減前日比	-1,400

<8月27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		-2,100
資金過不足		-2,300
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+1,300	-1,400
金融調節合計		-100
当座預金増減-②		-2,400

<8月27日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,235,000
準備預金残高	4,794,700
積み終了先	4,794,100
超過準備	4,794,000
非準備先残高	440,300

<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)	5,100
残り要積立額 (平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	38.7
進捗率乖離幅	+61.1

<8月28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		-2,500
資金過不足		-2,700
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+8,800
国債補完供給	+1,400	
金融調節合計		+10,200
当座預金増減		+7,500

<8月28日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残524兆2,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<8月28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	5,287,500	+52,500
+40,000	5,282,500	+47,500
+35,000	5,277,500	+42,500
+30,000	5,272,500	+37,500
+25,000	5,267,500	+32,500
+20,000	5,262,500	+27,500
+15,000	5,257,500	+22,500
+10,000	5,252,500	+17,500
+5,000	5,247,500	+12,500
± 0	5,242,500	+7,500
-5,000	5,237,500	+2,500
-10,000	5,232,500	-2,500
-15,000	5,227,500	-7,500
-20,000	5,222,500	-12,500
-25,000	5,217,500	-17,500
-30,000	5,212,500	-22,500
-35,000	5,207,500	-27,500
-40,000	5,202,500	-32,500
-45,000	5,197,500	-37,500

<8月27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(3Y-5Y)	25/ 8/28	3,250億	応札 6,441億	落札 3,253億	最低 +0.002%	平均 +0.004%	按分 78.9%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 8/28	3,500億	応札 6,309億	落札 3,504億	最低 -0.004%	平均 0.000%	按分 18.0%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 8/28	1,350億	応札 2,800億	落札 1,353億	最低 -0.003%	平均 +0.004%	按分 66.3%
(10:10) 国債買入(25Y-)	25/ 8/28	750億	応札 2,288億	落札 754億	最低 +0.011%	平均 +0.011%	按分 81.1%
(10:10) 国債買入(物国)	25/ 8/28	500億	応札 1,479億	落札 500億	按分 -0.060円	平均 -0.224円	按分 80.0%
(11:50) 国債補完供給	25/ 8/27-25/ 8/28		応札 1,129億	落札 1,129億	全取 +0.250%	平均 +0.250%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 8/27-25/ 8/28		応札 398億	落札 398億	全取 +0.250%	平均 +0.250%	

<8月27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	27,726	成長基盤強化支援資金供給	187			
8/20~ 9/ 3	8,005.	18,570	767,180	11/17~11/17	0.	
	8/21(1-3Y)	3,255.		11/18~11/17	57.	
	8/21(3-5Y)	3,254.	9/ 1~ 9/ 1	5,024.	2/16~ 2/16	0.
	8/21(5-10Y)	3,500.	9/ 5~ 9/ 5	1,661.	2/17~ 2/16	0.
	(8/28(3-5Y)	3,253.)	12/ 1~12/ 1	2,464.	5/12~ 5/12	0.
	(8/28(5-10Y)	3,504.)	12/ 4~12/ 4	842.	8/18~ 8/18	130.
	(8/28(10-25Y)	1,353.)	3/ 2~ 3/ 2	7,922.		
	(8/28(25Y-)	754.)	3/ 4~ 3/ 4	830.		
	(8/28(物国)	500.)	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	※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則	米ドル資金供給オペ		
			5,717百万ドル	0百万ドル		
			9/ 5~ 9/ 5	1,661.	8/21~ 8/28	0.
			12/ 4~12/ 4	842.	(8/28~ 9/ 4	2.)
			3/ 4~ 3/ 4	830.		
			6/ 3~ 6/ 3	2,384.		
			国債買現先オペ			
			0	国債売現先(米ドルオペ用担保)		
				0		
				国庫短期証券買入額(月初末)		
			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			
			1,527			
			8/27~ 8/28	1,129.		
			8/27~ 8/28	398.		
			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			
			共通担保(全店)金利入札			
			70,035			
			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.		
			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		1,527
			貸出(推定)			
			0	国債売(米ドル担保)		0
			供給額合計			
			974,780	吸収額合計		1,527
			差し引き			
						973,253

※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27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 +0.552000	3M 買気配 +0.530
1W	売気配 +0.400	2M +0.590000	6M 買気配 +0.600
2W	売気配 +0.400	3M +0.690000	1Y 買気配 +0.750
1M	売気配 +0.400		

<8月26日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	122,682	-131
有担保	31,771	-462
無担保	90,911	+331

<8月27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	0.478	± 0			0.430	± 0	0.488	± 0
トムネ				-----				-----	0.489	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.484	0.530	0.499	-----				-----	0.483	± 0
2週間物	0.471	0.530	0.497	+0.021				-----	0.482	-0.001
3週間物				-----				-----	0.483	± 0
1ヶ月物	0.535	0.560	0.552	-----				-----	0.486	-0.001
3ヶ月物			0.600	-0.018				-----	0.524	+0.004
6ヶ月物				-----				-----	0.553	+0.004
1年物				-----				-----	0.661	+0.005

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