

東京短資デイリーレポート

2025/9/3

<9月2日のマナリーベース>

6,404,200

<9月3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	5,155,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,185,500
日銀当座預金残高増減前日比	-29,600

<9月3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		-32,100
資金過不足		-32,300
金融調節		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
社債等買入	-200	
国債補完供給	+1,900	-1,200
金融調節合計		+500
当座預金増減-②		-31,800

<9月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,153,700
準備預金残高	4,717,400
積み終了先	4,717,100
超過準備	4,717,000
非準備先残高	436,300

<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)	800
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	61.3
進捗率乖離幅	+38.6

<9月4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		+4,600
資金過不足		+4,800
金融調節確定分		
国債買入		+8,300
社債等買入	-100	
国債補完供給	+1,200	
金融調節合計		+9,400
当座預金増減		+14,200

<9月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残516兆7,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<9月4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	5,212,900	+59,200
+40,000	5,207,900	+54,200
+35,000	5,202,900	+49,200
+30,000	5,197,900	+44,200
+25,000	5,192,900	+39,200
+20,000	5,187,900	+34,200
+15,000	5,182,900	+29,200
+10,000	5,177,900	+24,200
+5,000	5,172,900	+19,200
± 0	5,167,900	+14,200
-5,000	5,162,900	+9,200
-10,000	5,157,900	+4,200
-15,000	5,152,900	-800
-20,000	5,147,900	-5,800
-25,000	5,142,900	-10,800
-30,000	5,137,900	-15,800
-35,000	5,132,900	-20,800
-40,000	5,127,900	-25,800
-45,000	5,122,900	-30,800

<9月3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)	25/ 9/ 4	1,000億	応札 2,238億	落札 1,000億	最低 +0.013%	平均 +0.019%	按分 69.4%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	25/ 9/ 4	3,250億	応札 9,219億	落札 3,255億	最低 -0.007%	平均 -0.001%	按分 15.8%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	25/ 9/ 4	3,250億	応札 6,367億	落札 3,253億	最低 +0.001%	平均 +0.004%	按分 53.9%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/ 9/ 4	1,350億	応札 3,752億	落札 1,352億	最低 +0.050%	平均 +0.067%	按分 7.1%
(11:50) 国債補完供給	25/ 9/ 3-25/ 9/ 4		応札 1,215億	落札 1,215億	全取 +0.250%	平均 +0.250%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 9/ 3-25/ 9/ 4		応札 0億	落札 0億			

<9月3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
8,011	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
9/ 3~ 9/17 8,011.	8/28(3-5Y) 3,253. 8/28(5-10Y) 3,504. 8/28(10-25Y) 1,353. 8/28(25Y-) 754. 8/28(物国) 500. (9/ 4(-1Y) 1,000.) (9/ 4(1-3Y) 3,255.) (9/ 4(3-5Y) 3,253.) (9/ 4(10-25Y) 1,352.)	1 3,5 4 6 7 6 7, 1 8 0	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	※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	※直近約1年分の期落ち分を記載 米ドル資金供給オペ
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.	9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4-12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830. 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. 6/17~ 3/16 18,695. 3/18~ 6/18 70,188. 6/20~ 6/19 46,265.	9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~ 9/11 0.) 0 0 0 0 0 0 0 0
国債補完供給	1,215	国債買現先オペ	国債売現先(米ドルオペ用担保)
9/ 3~ 9/ 4 1,215. 9/ 3~ 9/ 4 0.	0	0	0
ETF買入額	356,921	国債売現先オペ	0
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	14,628	国債買現先オペ	0
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額	6,823	国債売現先オペ	0
約定 22/ 6/14 12.	0	0	0
		CP買入額(月初末)	0
		0	0
		社債買入額(月初末)	0
		0	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	10,201
		貸出増加支援	710,030
		供給オペ合計	969,762
		貸出(推定)	0
		供給額合計	969,762
		手形売出	0
		国債売現先	0
		国債補完供給	1,215
		国債売現先(米ドル担保)	0
		吸収額合計	1,215
		差し引き	968,547

※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。

<9月3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 +0.548000	3M 買気配 +0.500
1W	売気配 +0.400	2M +0.570000	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		

<9月2日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	120,881	+261
有担保	30,634	-298
無担保	90,247	+559

<9月3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	-0.001
トムネ				-----				-----	0.488	-0.004
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.484	-0.051				-----	0.482	± 0
2週間物	0.470	0.481	0.477	-0.033				-----	0.482	± 0
3週間物				-----				-----	0.482	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.484	± 0
3ヶ月物			0.600	-----				-----	0.531	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.568	± 0
1年物				-----				-----	0.671	-0.001

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ようをお願いいたします。
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