

東京短資デイリーレポート

2025/9/4

<9月3日のマナリーベース>

6,372,600

<9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	5,167,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,153,700
日銀当座預金残高増減前日比	+14,200

<9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	+200	
財政等要因	+3,700	
資金過不足	+3,900	
金融調節		
国債買入	期落	新規
		+8,300
社債等買入	-100	
国債補完供給	+1,200	-1,600
金融調節合計		+7,800
当座預金増減-②		+11,700

<9月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,165,400
準備預金残高	4,737,000
積み終了先	4,736,600
超過準備	4,736,600
非準備先残高	428,400

<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)	400
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	64.5
進捗率乖離幅	+35.4

<9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	+900	
財政等要因	-7,300	
資金過不足	-6,400	
金融調節確定分		
国債補完供給	期落	新規
	+1,600	
金融調節合計		+1,600
当座預金増減		-4,800

<9月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残516兆600億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での出合いが中心か。
--

<9月5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	5,205,600	+40,200
+40,000	5,200,600	+35,200
+35,000	5,195,600	+30,200
+30,000	5,190,600	+25,200
+25,000	5,185,600	+20,200
+20,000	5,180,600	+15,200
+15,000	5,175,600	+10,200
+10,000	5,170,600	+5,200
+5,000	5,165,600	+200
± 0	5,160,600	-4,800
-5,000	5,155,600	-9,800
-10,000	5,150,600	-14,800
-15,000	5,145,600	-19,800
-20,000	5,140,600	-24,800
-25,000	5,135,600	-29,800
-30,000	5,130,600	-34,800
-35,000	5,125,600	-39,800
-40,000	5,120,600	-44,800
-45,000	5,115,600	-49,800

<9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。

(11:50) 国債補完供給	25/ 9/ 4-25/ 9/ 5	応札	1,735億	落札	1,735億	全取	+0.250%	平均	+0.250%
(13:50) 国債補完供給	25/ 9/ 4-25/ 9/ 5	応札	0億	落札	0億				

<9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)	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	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	
8,011	8,860				187	
9/ 3~ 9/17	8,011.	8/28(3-5Y) 3,253.	1 3,5 4 6	7 6 7, 1 8 0	11/17~11/17 0.	
		8/28(5-10Y) 3,504.	9/ 5~ 9/ 5 1,661.	9/15~ 9/12 27,659.	11/18~11/17 57.	
		8/28(10-25Y) 1,353.	12/ 1~12/ 1 2,464.	9/13~ 9/12 121,454.	2/16~ 2/16 0.	
		8/28(25Y-) 754.	12/ 4~12/ 4 842.	12/15~12/15 20,129.	2/17~ 2/16 0.	
		8/28(物国) 500.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	12/13~12/15 33,838.	5/12~ 5/12 0.	
		9/ 4(-1Y) 1,000.	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/16~ 3/16 38,879.	8/18~ 8/18 130.	
		9/ 4(1-3Y) 3,255.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	3/17~ 3/16 18,695.		
		9/ 4(3-5Y) 3,253.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/18~ 6/18 70,188.		
		9/ 4(10-25Y) 1,352.		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.	9/ 4~ 9/11 0.	気候変動対応支援資金供給	
			12/ 4~12/ 4 842.		171,298	
			3/ 4~ 3/ 4 830.		1/30~ 1/30 69,704.	
			6/ 3~ 6/ 3 2,384.		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			
			1,735			
			9/ 4~ 9/ 5 1,735.			
			9/ 4~ 9/ 5 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			
			※直近約1週間の実施分を記載			
			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4日 日銀信用概算(除く買切)>			
			共通担保(全)固定	8,011	CP等買入(推定)	5,300
			共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	36,600
			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	手形売切	0
			貸出増加支援	710,030	国債売現先	0
			供給オペ合計	969,762	国債補完供給	1,735
			貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
			供給額合計	969,762	吸収額合計	1,735
				差し引き	968,027	

<9月4日のオープン市場気配レート(単位:%)>

	NCD/CP現先	CPプライマリー	TBアウトライト
S/N	売気配 +0.400	1M +0.556000	3M 買気配 +0.500
1W	売気配 +0.400	2M -----	6M 買気配 +0.600
2W	売気配 +0.400	3M +0.698000	1Y 買気配 +0.750
1M	売気配 +0.400		

<9月3日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	121,033	+152
有担保	29,982	-652
無担保	91,051	+804

<9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	0.479	+0.001			0.430	± 0	0.487	-0.001
トムネ				-----				-----	0.485	-0.003
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.482	± 0
2週間物	0.460	0.470	0.465	-0.012				-----	0.482	± 0
3週間物				-----				-----	0.481	-0.001
1ヶ月物	0.550	0.620	0.585	-----				-----	0.484	± 0
3ヶ月物				-----				-----	0.531	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.568	± 0
1年物				-----				-----	0.671	± 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