

東京短資デイリーレポート

2025/2/25

<2月21日のマネタリーベース>

6,536,300

<2月25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	5,324,100
前日の日銀当座預金残高-①	5,295,700
日銀当座預金残高増減前日比	+28,400

<2月25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	-100	
財政等要因	+25,700	
資金過不足	+25,600	
金融調節		
CP等買入	期落	新規
社債等買入	-200	
国債補完供給	+3,300	-5,500
金融調節合計		-2,600
当座預金増減-②		+23,000

<2月25日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,318,700
準備預金残高	4,848,300
積み終了先	4,846,900
超過準備	4,846,900
非準備先残高	470,400

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,681,900
今積み期間所要準備額(平均)	131,500
残り要積立額(積数)	6,300
残り要積立額(平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	35.7
進捗率乖離幅	+64.1

<2月26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	-2,000	
資金過不足	-1,800	
金融調節確定分		
国債補完供給	期落	新規
金融調節合計	+5,500	
当座預金増減		+3,700

<2月26日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残532兆2,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での合いが中心か。

<2月26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	5,367,400	+48,700
+40,000	5,362,400	+43,700
+35,000	5,357,400	+38,700
+30,000	5,352,400	+33,700
+25,000	5,347,400	+28,700
+20,000	5,342,400	+23,700
+15,000	5,337,400	+18,700
+10,000	5,332,400	+13,700
+5,000	5,327,400	+8,700
± 0	5,322,400	+3,700
-5,000	5,317,400	-1,300
-10,000	5,312,400	-6,300
-15,000	5,307,400	-11,300
-20,000	5,302,400	-16,300
-25,000	5,297,400	-21,300
-30,000	5,292,400	-26,300
-35,000	5,287,400	-31,300
-40,000	5,282,400	-36,300
-45,000	5,277,400	-41,300

<2月25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/ 2/27-25/ 3/ 6	応札 0m1 落札 0m1	貸付 4.580%
(11:50) 国債補完供給	25/ 2/25-25/ 2/26	応札 5,748億 落札 5,748億 全取 +0.250% 平均 +0.250%	
(13:50) 国債補完供給	25/ 2/25-25/ 2/26	応札 0億 落札 0億	

<2月25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(月初来)	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
8,009	36,793	28,007	836,939	517
2/19~ 3/ 5 8,009.	2/20(1-3Y) 3,001. 2/20(3-5Y) 3,008. 2/20(5-10Y) 3,254. 2/20(25Y-) 750.	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.	5/12~ 5/12 181. 5/17~ 5/12 0. 8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/17~11/17 0. 11/18~11/17 57. 2/16~ 2/16 0. 2/17~ 2/16 0.
共通担保(全店)金利入札		成長基盤強化支援米ドル特別		被災地金融機関支援資金供給
70,035		9,918百万ドル	2百万ドル	517
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.	(2/27~ 3/ 6 0.)	2	気候変動対応支援資金供給
国債補完供給		国債買入額(固定利回)(月初来)		7/19~ 7/18 72,361. 1/30~ 1/30 69,704.
5,748	0	0		
2/25~ 2/26 5,748. 2/25~ 2/26 0.		国債売現先(米ドルオペ用担保)		
ETF買入額		0		
356,921		2		
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)		2/19~ 2/28 2.		
14,628		国債短期証券買入額(月初来)		
約定 21/ 3/31 12.		0		
J-REIT買入額		国債売現先オペ		
6,823		0		
約定 22/ 6/14 12.		C P買入額(月初来)		
		0		
社債買入額(月初来)		0		
0		0		

<2月25日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定	8,009	CP等買入(推定)	15,100
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	49,500
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	517		
気候変動対応支援	142,065		
成長基盤支援	24,018	手形売出	0
貸出増加支援	771,475	国債売現先	0
供給オペ合計	1,016,119	国債補完供給	5,748
貸出(推定)	0	国債現(米ドル担保)	2
供給額合計	1,016,119	吸収額合計	5,750
差し引き	1,010,369		

※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25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 +0.400	1M +0.540000	3M 買気配 +0.350
1W 売気配 +0.400	2M +0.580000	6M 買気配 +0.450
2W 売気配 +0.400	3M +0.610000	1Y 買気配 +0.450
1M 売気配 +0.400		

<2月21日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	118,701	+1,133
有担保	36,897	+87
無担保	81,804	+1,046

<2月25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	0.492	-0.005
トムネ				-----				-----	0.491	-0.005
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.550	0.560	0.551	-0.005				-----	0.445	-0.002
2週間物				-----				-----	0.441	± 0
3週間物	0.550	0.580	0.560	-0.050				-----	0.439	+0.005
1ヶ月物				-----				-----	0.435	+0.003
3ヶ月物				-----				-----	0.457	+0.003
6ヶ月物				-----				-----	0.489	± 0
1年物				-----				-----	0.577	+0.013

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