

東京短資デイリーレポート

2025/8/4

<8月1日のマナリーベース>

6,482,900

<8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	5,207,700
前日の日銀当座預金残高-①	5,263,900
日銀当座預金残高増減前日比	-56,200

<8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		+100
財政等要因		-61,700
資金過不足		-61,600
金融調節		
国債補完供給	期落	新規
国債補完供給	+2,600	-4,300
金融調節合計		-1,700
当座預金増減-②		-63,300

<8月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	5,200,600
準備預金残高	4,719,100
積み終了先	4,719,100
超過準備	4,719,100
非準備先残高	481,500

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,121,200
今積み期間所要準備額 (平均)	132,900
残り要積立額 (積数)	300
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

<8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		+500
財政等要因		+3,800
資金過不足		+4,300
金融調節確定分		
国債補完供給	期落	新規
国債補完供給	+4,300	
金融調節合計		+4,300
当座預金増減		+8,600

<8月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残520兆9,200億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での出合いが中心か。
--

<8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	5,254,200	+53,600
+40,000	5,249,200	+48,600
+35,000	5,244,200	+43,600
+30,000	5,239,200	+38,600
+25,000	5,234,200	+33,600
+20,000	5,229,200	+28,600
+15,000	5,224,200	+23,600
+10,000	5,219,200	+18,600
+5,000	5,214,200	+13,600
± 0	5,209,200	+8,600
-5,000	5,204,200	+3,600
-10,000	5,199,200	-1,400
-15,000	5,194,200	-6,400
-20,000	5,189,200	-11,400
-25,000	5,184,200	-16,400
-30,000	5,179,200	-21,400
-35,000	5,174,200	-26,400
-40,000	5,169,200	-31,400
-45,000	5,164,200	-36,400

<8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/ 8/ 4-25/ 8/ 5	応札 3,560億 落札 3,560億 全取 +0.250% 平均 +0.207%
(13:50) 国債補完供給	25/ 8/ 4-25/ 8/ 5	応札 1,000億 落札 1,000億 全取 +0.250% 平均 +0.250%

<8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	被災地金融機関支援資金供給	
8,009	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
7/23~ 8/ 6 8,009.	7/29(5-10Y) 3,505. 7/29(10-25Y) 1,351. 7/29(25Y-) 751. 7/29(物国) 500.	18,570 767,180 9/ 1~ 9/ 1 5,024. 9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 3,160. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	336 279. 0. 57. 0. 0. 0. 0. 0. 0. 279. 8/19~ 8/18 279. 8/18~ 8/18 0. 11/18~11/17 57. 11/17~11/17 0. 2/16~ 2/16 0. 2/17~ 2/16 0. 5/12~ 5/12 0.	
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	※直近約1年分の期落ち分を記載	
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.	国債買入額(固定利回)(月初末)	米ドル資金供給オペ	気候変動対応支援資金供給	
国債補完供給	4,560	5,717百万ドル	0百万ドル	
8/ 4~ 8/ 5 3,560. 8/ 4~ 8/ 5 1,000.	0	9/ 5~ 9/ 5 1,661. 12/ 4~12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	7/31~ 8/ 7 0.	171,298 1/30~ 1/30 69,704. 7/18~ 7/21 101,594.
ETF買入額	356,921	国債買入先オペ	0	
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	14,628	0	0	
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額	6,823	国債売先オペ	0	
約定 22/ 6/14 12.	0	0	0	
		※直近約1週間の実施分を記載		
		CP買入額(月初末)	0	
		0		
		社債買入額(月初末)	0	
		0		

<8月4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)	6,400
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	37,700
国債買入先	0		
被災地金融機関支援	336		
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	国債売先	0
供給オペ合計	974,933	国債補完供給	4,560
貸出(推定)	0	国債売先(米ドル担保)	0
供給額合計	974,933	吸収額合計	4,560
		差し引き	970,373

※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	TBアウトライト
S/N 売気配 +0.400	1M	+0.515000	3M 買気配 +0.500
1W 売気配 +0.400	2M	+0.545000	6M 買気配 +0.600
2W 売気配 +0.400	3M	-----	1Y 買気配 +0.700
1M 売気配 +0.400			

<8月1日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	113,380	+3,909
有担保	34,143	+5,323
無担保	79,237	-1,414

<8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	0.478	0.476	-0.001			0.430	± 0	0.496	± 0
トムネ				-----				-----	0.493	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.484	0.610	0.545	+0.015				-----	0.482	± 0
2週間物			0.478	-0.004				-----	0.482	± 0
3週間物				-----				-----	0.481	± 0
1ヶ月物			0.530	-0.026				-----	0.482	-0.001
3ヶ月物	0.585	0.590	0.588	-0.041				-----	0.497	-0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.529	-0.002
1年物				-----				-----	0.611	± 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