

東京短資デイリーレポート

2025/9/11

<9月10日のマネタリーベース>

| |
|-----------|
| 6,351,300 |
|-----------|

<9月11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 | 5,112,600 |
| 前日の日銀当座預金残高-① | 5,135,100 |
| 日銀当座預金残高増減前日比 | -22,500 |

<9月11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 | | -25,800 |
| 資金過不足 | | -25,900 |
| 金融調節 | | |
| 国債補完供給 | 期落 | 新規 |
| | +2,700 | -2,400 |
| 金融調節合計 | | +300 |
| 当座預金増減-② | | -25,600 |

<9月11日の日銀当座預金状況>

| | |
|--------------|-----------|
| 当座預金残高 (①+②) | 5,109,500 |
| 準備預金残高 | 4,674,000 |
| 積み終了先 | 4,674,000 |
| 超過準備 | 4,674,000 |
| 非準備先残高 | 435,500 |

<参考>

| | |
|-----------------|-----------|
| 今積み期間所要準備額 (積数) | 4,113,800 |
| 今積み期間所要準備額 (平均) | 132,700 |
| 残り要積立額 (積数) | 0 |
| 残り要積立額 (平均) | 0 |
| 準備進捗率(%) | 100.0 |
| 日数進捗率(%) | 87.1 |
| 進捗率乖離幅 | +12.9 |

<9月12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 | | +300 |
| 財政等要因 | | +9,000 |
| 資金過不足 | | +9,300 |
| 金融調節確定分 | | |
| 国債買入 | 期落 | 新規 |
| | | +8,400 |
| 社債等買入 | | -400 |
| 国債補完供給 | | +2,400 |
| 貸出増加支援 | | -144,900 |
| 金融調節合計 | | -123,800 |
| 当座預金増減 | | -114,500 |

<9月12日のオペ予想>

| |
|---|
| 朝一の金融調節はノーオペ (当預残499兆5,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。 |
|---|

<9月12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 | 5,040,000 | -69,500 |
| +40,000 | 5,035,000 | -74,500 |
| +35,000 | 5,030,000 | -79,500 |
| +30,000 | 5,025,000 | -84,500 |
| +25,000 | 5,020,000 | -89,500 |
| +20,000 | 5,015,000 | -94,500 |
| +15,000 | 5,010,000 | -99,500 |
| +10,000 | 5,005,000 | -104,500 |
| +5,000 | 5,000,000 | -109,500 |
| ± 0 | 4,995,000 | -114,500 |
| -5,000 | 4,990,000 | -119,500 |
| -10,000 | 4,985,000 | -124,500 |
| -15,000 | 4,980,000 | -129,500 |
| -20,000 | 4,975,000 | -134,500 |
| -25,000 | 4,970,000 | -139,500 |
| -30,000 | 4,965,000 | -144,500 |
| -35,000 | 4,960,000 | -149,500 |
| -40,000 | 4,955,000 | -154,500 |
| -45,000 | 4,950,000 | -159,500 |

<9月11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-3Y) | 25/ 9/12 | 3,250億 | 応札 9,892億 | 落札 3,253億 | 最低 +0.001% | 平均 +0.005% | 按分 26.7% |
| (10:10) 国債買入(5Y-10Y) | 25/ 9/12 | 3,500億 | 応札 7,599億 | 落札 3,501億 | 最低 -0.001% | 平均 +0.002% | 按分 20.3% |
| (10:10) 国債買入(10Y-25Y) | 25/ 9/12 | 1,350億 | 応札 3,980億 | 落札 1,354億 | 最低 -0.002% | 平均 0.000% | 按分 40.6% |
| (10:10) 国債買入(25Y-) | 25/ 9/12 | 750億 | 応札 2,183億 | 落札 751億 | 最低 -0.008% | 平均 -0.003% | 按分 84.1% |
| (11:50) 国債補完供給 | 25/ 9/11-25/ 9/12 | | 応札 2,162億 | 落札 2,162億 | 全取 +0.250% | 平均 +0.250% | |
| (13:50) 国債補完供給 | 25/ 9/11-25/ 9/12 | | 応札 360億 | 落札 360億 | 全取 +0.250% | 平均 +0.250% | |

<9月11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) | 貸出増加支援資金供給 | 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 | 成長基盤強化支援資金供給 | 貸出増加支援資金供給 | 187 | | |
| 9/ 3~ 9/17 | 8,011. | 13,546 | 767,180 | 11/17-11/17 | 0. | |
| | 9/ 4(-1Y) | 1,000. | | 11/18-11/17 | 57. | |
| | 9/ 4(1-3Y) | 3,255. | 12/ 1-12/ 1 | 2,464. | 2/16~ 2/16 | 0. |
| | 9/ 4(3-5Y) | 3,253. | 9/15~ 9/12 | 27,659. | 2/17~ 2/16 | 0. |
| | 9/ 4(10-25Y) | 1,352. | 9/13~ 9/12 | 121,454. | 5/12~ 5/12 | 0. |
| | (9/12(1-3Y) | 3,253.) | 12/15-12/15 | 20,129. | 8/18~ 8/18 | 130. |
| | (9/12(5-10Y) | 3,501.) | 3/ 2~ 3/ 2 | 7,922. | | |
| | (9/12(10-25Y) | 1,354.) | 3/ 4~ 3/ 4 | 842. | | |
| | (9/12(25Y-) | 751.) | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 3,160. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/12(10-25Y) | 1,354. | | |
| | | | 9/12(25Y-) | 751. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ 4 | 830. | | |
| | | | 6/ 3~ 6/ 3 | 2,384. | | |
| | | | 9/11~ 9/18 | 2. | | |
| | | | 12/ 4-12/ 4 | 842. | | |
| | | | 3/ 4~ 3/ | | | |