

東京短資デイリーレポート

2025/9/16

<9月12日のマネタリーベース>

6,205,200

<9月16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	4,987,700
前日の日銀当座預金残高-①	4,989,200
日銀当座預金残高増減前日比	-1,500

<9月16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		+300
財政等要因		-200
資金過不足		+100
金融調節		
国債補完供給	期落	新規
	+1,800	-2,500
金融調節合計		-700
当座預金増減-②		-600

<9月16日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,988,600
準備預金残高	4,563,400
積み終了先	2,634,000
超過準備	1,212,100
非準備先残高	425,200

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,983,200
今積み期間所要準備額 (平均)	132,800
残り要積立額 (積数)	631,900
残り要積立額 (平均)	21,800
準備進捗率(%)	84.1
日数進捗率(%)	3.3
進捗率乖離幅	+80.8

<9月17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		+400
財政等要因		+2,300
資金過不足		+2,700
金融調節確定分		
共通担保(全店)	期落	新規
	-8,000	+8,000
社債等買入		-300
国債補完供給		+2,500
金融調節合計		+2,200
当座預金増減		+4,900

<9月17日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残499兆3,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<9月17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	5,038,500	+49,900
+40,000	5,033,500	+44,900
+35,000	5,028,500	+39,900
+30,000	5,023,500	+34,900
+25,000	5,018,500	+29,900
+20,000	5,013,500	+24,900
+15,000	5,008,500	+19,900
+10,000	5,003,500	+14,900
+5,000	4,998,500	+9,900
± 0	4,993,500	+4,900
-5,000	4,988,500	-100
-10,000	4,983,500	-5,100
-15,000	4,978,500	-10,100
-20,000	4,973,500	-15,100
-25,000	4,968,500	-20,100
-30,000	4,963,500	-25,100
-35,000	4,958,500	-30,100
-40,000	4,953,500	-35,100
-45,000	4,948,500	-40,100

<9月16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/ 9/18-25/ 9/26	応札	1m1l 落札	1m1l	貸付	4.360%
(11:50) 国債補完供給	25/ 9/16-25/ 9/17	応札	2,634億 落札	2,634億	全取	+0.250% 平均 +0.250%
(13:00) 共通担保(全)固	25/ 9/17-25/10/ 1	8,000億	応札	17,428億 落札	8,003億	貸付 0.500% 按分 45.9%
(13:50) 国債補完供給	25/ 9/16-25/ 9/17		応札	0億 落札	0億	
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	25/ 9/17-25/ 9/29	5,000億	応札	2億 落札	2億	全取 +0.470% 平均 +0.470%

<9月16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	17,719	成長基盤強化支援資金供給	187	
9/ 3~ 9/17 8,011. (9/17~10/ 1 8,003.)	9/12(1-3Y) 3,253. 9/12(5-10Y) 3,501. 9/12(10-25Y) 1,354. 9/12(25Y-) 751.	13,546 628,760 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.	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	※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	0	4,056百万ドル	2百万ドル	
2,634 9/16~ 9/17 2,634. 9/16~ 9/17 0.	0	12/ 4~12/ 4 842. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	9/11~ 9/18 2. (9/18~ 9/26 1.)	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	国債売先(米ドルオペ用担保)	
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額	6,823	0	4	
約定 22/ 6/14 12.	0	0	9/10~ 9/19 4. (9/17~ 9/29 2.)	
		CP買入額(月初末)	0	
		0	国庫短期証券買入額(月初末)	
		0	0	

<9月16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)	36,000
国債買入先	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	12,791	手形売出	0
貸出増加支援	575,775	国債売先	0
供給オペ合計	838,097	国債補完供給	2,634
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	4
供給額合計	838,097	吸収額合計	2,638
		差し引き	835,459

※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16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 +0.530000	3M 買気配 +0.500	
1W 売気配 +0.400	2M買気配 +0.591000	6M 買気配 +0.550	
2W 売気配 +0.400	3M +0.688000	1Y 買気配 +0.800	
1M 売気配 +0.400			

<9月12日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	118,854	-936
有担保	31,541	+223
無担保	87,313	-1,159

<9月16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	0.445	0.478	0.477	± 0			0.430	± 0	0.492	-0.006
トムネ			0.440	-----				-----	0.495	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.484	0.530	0.499	-0.111				-----	0.482	± 0
2週間物	0.468	0.482	0.477	-----				-----	0.482	± 0
3週間物				-----				-----	0.480	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.482	-0.002
3ヶ月物				-----				-----	0.524	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.570	-0.001
1年物				-----				-----	0.675	+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