

東京短資デイリーレポート

2025/10/2

<10月1日のマネタリーベース>

6,201,800

<10月2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	4,943,600
前日の日銀当座預金残高-①	4,987,900
日銀当座預金残高増減前日比	-44,300

<10月2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	-39,100
資金過不足	-39,000
金融調節	
国債補完供給	+3,000
金融調節合計	-500
当座預金増減-②	-39,500

<10月2日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,948,400
準備預金残高	4,495,700
積み終了先	4,495,600
超過準備	4,495,600
非準備先残高	452,700

<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)	400
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	56.7
進捗率乖離幅	+43.2

<10月3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	-27,700
資金過不足	-28,000
金融調節確定分	
国債補完供給	+3,500
金融調節合計	+3,500
当座預金増減	-24,500

<10月3日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残492兆3,900億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での出合いが中心か。
--

<10月3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	4,968,900	+20,500
+40,000	4,963,900	+15,500
+35,000	4,958,900	+10,500
+30,000	4,953,900	+5,500
+25,000	4,948,900	+500
+20,000	4,943,900	-4,500
+15,000	4,938,900	-9,500
+10,000	4,933,900	-14,500
+5,000	4,928,900	-19,500
± 0	4,923,900	-24,500
-5,000	4,918,900	-29,500
-10,000	4,913,900	-34,500
-15,000	4,908,900	-39,500
-20,000	4,903,900	-44,500
-25,000	4,898,900	-49,500
-30,000	4,893,900	-54,500
-35,000	4,888,900	-59,500
-40,000	4,883,900	-64,500
-45,000	4,878,900	-69,500

<10月2日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	25/10/ 2-25/10/ 3	応札 3,492億 落札 3,492億 全取 +0.250% 平均 +0.250%
(13:50) 国債補完供給	25/10/ 2-25/10/ 3	応札 201億 落札 201億 全取 +0.250% 平均 +0.250%

<10月2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	187
10/ 1-10/15 8,009.	9/25(1-3Y) 3,252.	1 3,546	6 28,760
	9/25(3-5Y) 3,252.	12/ 1-12/ 1 2,464.	12/15-12/15 20,129.
	9/25(5-10Y) 3,502.	12/ 4-12/ 4 842.	12/13-12/15 33,838.
	9/25(10-25Y) 1,352.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/16~ 3/16 38,879.
	9/30(3-5Y) 3,257.	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.
	9/30(5-10Y) 3,504.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 70,188.
	9/30(25Y-) 751.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/20~ 6/19 46,265.
	9/30(物国) 500.		9/14~ 9/14 30,590.
			9/12~ 9/14 10,693.
		※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別	米ドル資金供給オペ
		4,056百万ドル	0百万ドル
		12/ 4-12/ 4 842.	10/ 2-10/ 9 0.
		3/ 4~ 3/ 4 830.	
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	
		国債買現先オペ	0
		0	0
		国債売現先(米ドルオペ用担保)	0
		0	0
		国債売現先オペ	0
		0	0
		※直近約1週間の実施分を記載	※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
		0	0
		国債補完供給	3,693
		10/ 2-10/ 3 3,492.	
		10/ 2-10/ 3 201.	
		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
		0	
		社債買入額(月初末)	0
		0	

<10月2日 日銀信用概算(除く買切)>	
共通担保(全)固定	8,009
共通担保(全)金入	70,035
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	12,791
貸出増加支援	575,775
供給オペ合計	838,095
貸出(推定)	0
供給額合計	838,095
CP等買入(推定)	3,900
社債等買入(推定)	35,000
手形売出	0
国債売現先	0
国債補完供給	3,693
国債現(米ドル担保)	0
吸収額合計	3,693
差し引き	834,402

※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。

<10月2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	+0.570000	3M	買気配 +0.550
1W	売気配 +0.400	2M	-----	6M	買気配 +0.550
2W	売気配 +0.400	3M	-----	1Y	買気配 +0.800
1M	売気配 +0.400				

<10月1日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	104,903	+4,706
有担保	24,628	+401
無担保	80,275	+4,305

<10月2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	0.530	0.477	± 0			0.430	± 0	0.491	-0.003
トムネ				-----				-----	0.491	-0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.525	0.610	0.545	+0.021				-----	0.483	± 0
2週間物	0.471	0.481	0.477	+0.007				-----	0.483	+0.001
3週間物				-----				-----	0.483	+0.001
1ヶ月物				-----				-----	0.486	+0.002
3ヶ月物				-----				-----	0.571	+0.006
6ヶ月物				-----				-----	0.610	+0.002
1年物				-----				-----	0.721	+0.002

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