

東京短資デイリーレポート

2025/10/7

<10月6日のマネタリーベース>

6,144,900

<10月7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	4,932,600
前日の日銀当座預金残高-①	4,931,600
日銀当座預金残高増減前日比	+1,000

<10月7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	+600	
財政等要因	+900	
資金過不足	+1,500	
金融調節		
期落	新規	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+1,000	-2,900
金融調節合計		-2,000
当座預金増減-②		-500

<10月7日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,931,100
準備預金残高	4,474,300
積み終了先	4,474,300
超過準備	4,474,300
非準備預金残高	456,800

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,978,100
今積み期間所要準備額(平均)	132,600
残り要積立額(積数)	100
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	73.3
進捗率乖離幅	+26.6

<10月8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	-11,000	
資金過不足	-10,800	
金融調節確定分		
期落	新規	
国債補完供給	+2,900	
金融調節合計		+2,900
当座預金増減		-7,900

<10月8日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残492兆3,200億円)で
無担保コール0/NIは+0.471%~+0.477%での出合いが中心か。

<10月8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	4,968,200	+37,100
+40,000	4,963,200	+32,100
+35,000	4,958,200	+27,100
+30,000	4,953,200	+22,100
+25,000	4,948,200	+17,100
+20,000	4,943,200	+12,100
+15,000	4,938,200	+7,100
+10,000	4,933,200	+2,100
+5,000	4,928,200	-2,900
±0	4,923,200	-7,900
-5,000	4,918,200	-12,900
-10,000	4,913,200	-17,900
-15,000	4,908,200	-22,900
-20,000	4,903,200	-27,900
-25,000	4,898,200	-32,900
-30,000	4,893,200	-37,900
-35,000	4,888,200	-42,900
-40,000	4,883,200	-47,900
-45,000	4,878,200	-52,900

<10月7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	25/10/ 9-25/10/16	応札 0mil	落札 0mil	貸付 4,350%
(11:50) 国債補完供給	25/10/ 7-25/10/ 8	応札 2,910億	落札 2,910億	全取 +0.250% 平均 +0.250%
(13:50) 国債補完供給	25/10/ 7-25/10/ 8	応札 79億	落札 79億	全取 +0.250% 平均 +0.250%

<10月7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	+600
	財政等要因	+900
	資金過不足	+1,500
金融調節		
期落	新規	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+1,000	-2,900
金融調節合計		-2,000
当座預金増減-②		-500

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初来)	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
10/ 1~10/15	8,009.	1 3 , 5 4 6	1 8 7
		6 2 8 , 7 6 0	
		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.	

※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則	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.	(10/ 9~10/16 0.)
6/ 3~6/ 3 2,384.	
	気候変動対応支援資金供給
	1 7 1 , 2 9 8
	1/30~1/30 69,704.
	7/18~7/21 101,594.

国債買入額(月初来)	0	国債売現先(米ドルオペ用担保)
		0
		国庫短期証券買入額(月初来)
		0
		国債売現先オペ
		0
		成長基盤支援
		12,791
		手形売出 0
		貸出増加支援 575,775 国債売現先 0
		供給オペ合計 838,095 国債補完供給 2,989
		貸出(推定) 0 国債現(米ドル担保) 0
		供給額合計 838,095 吸収額合計 2,989
		差し引き 835,106

※直近約1週間の実施分を記載

国債買入額(固定利回)	0	
		社債買入額(月初来)
		0
		ETF買入額
		3 5 6 , 9 2 1
		約定 23/10/ 4 701.
		ETF買入額(企業支援)
		1 4 , 6 2 8
		約定 21/ 3/31 12.
		J-REIT買入額
		6 , 8 2 3
		約定 22/ 6/14 12.

※直近約1週間の実施分を記載

※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7日のオーブン市場気配レート(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 +0.525000	3M 買気配 +0.500
1W 売気配 +0.400	2M -----	6M 買気配 +0.600
2W 売気配 +0.400	3M +0.750000	1Y 買気配 +0.600
1M 売気配 +0.400		

<10月6日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高	増減
111,480	+2,050	
25,299	-373	
86,181	+2,423	

<10月7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
翌日物	0.450	0.530	0.477	± 0	0.430	± 0	0.489	-0.003
トムズ								
スボネ								
1週間物	0.485	0.510	0.489	-----			0.483	± 0
2週間物	0.460	0.481	0.470	-0.003			0.483	± 0
3週間物							0.482	± 0
1ヶ月物							0.490	+0.002
3ヶ月物					0.610	-----	0.552	-0.004
6ヶ月物							0.606	-0.001
1年物							0.710	-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