

東京短資デイリー・レポート

2025/10/8

<10月7日のマネタリーベース>

6,143,700

<10月8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	4,923,200
前日の日銀当座預金残高-①	4,931,100
日銀当座預金残高増減前日比	-7,900

＜10月8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	+200
財政等要因	-8,500
資金過不足	-8,300

金融調節		期落	新規
国債補完供給	+2,900	-2,800	
金融調節合計		+100	
当座預金増減-②		-8,200	

<10月8日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,922,900
準備預金残高	4,479,000
積み終了先	4,479,000
超過準備	4,479,000
非準預金残高	443,900

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（%）	76.7
進捗率乖離幅	+23.2

【10月9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		-1,600
資金過不足		-2,100
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
国債補完供給	+2,800	+8,000
金融調節合計		+10,800
当座預金増減		+8,700

<10月9日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残493兆1,600億円)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9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	4,976,600	+53,700
+40,000	4,971,600	+48,700
+35,000	4,966,600	+43,700
+30,000	4,961,600	+38,700
+25,000	4,956,600	+33,700
+20,000	4,951,600	+28,700
+15,000	4,946,600	+23,700
+10,000	4,941,600	+18,700
+5,000	4,936,600	+13,700
± 0	4,931,600	+8,700
-5,000	4,926,600	+3,700
-10,000	4,921,600	-1,300
-15,000	4,916,600	-6,300
-20,000	4,911,600	-11,300
-25,000	4,906,600	-16,300
-30,000	4,901,600	-21,300
-35,000	4,896,600	-26,300
-40,000	4,891,600	-31,300
-45,000	4,886,600	-36,300

<10月8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)	25/10/ 9	1,000億	応札 4,392億 落札 1,001億	最低 +0.016%	平均 +0.019%	按分 17.7%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	25/10/ 9	3,000億	応札 9,597億 落札 3,007億	最低 +0.017%	平均 +0.019%	按分 1.5%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/10/ 9	3,050億	応札 7,472億 落札 3,053億	最低 +0.014%	平均 +0.016%	按分 20.3%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	25/10/ 9	1,150億	応札 4,478億 落札 1,151億	最低 +0.013%	平均 +0.014%	按分 86.6%
(11:50) 国債償完供給	25/10/ 8-25/10/ 9		応札 2,893億 落札 2,893億	全取 +0.250%	平均 +0.250%	
(13:50) 国債償完供給	25/10/ 8-25/10/ 9		応札 0億 落札 0億			

<10月8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	187
10/ 1~10/15	8,009.	(10/ 9(-1Y) 1,001.) (10/ 9(1-3Y) 3,007.) (10/ 9(5-10Y) 3,053.) (10/ 9(10-25Y) 1,151.)	1 3 , 5 4 6 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.	6 2 8 , 7 6 0 12/15~12/15 20,129. 12/13~12/15 33,838. 3/16~ 3/16 38,879. 6/18~ 6/18 70,188. 6/20~ 6/19 46,265. 9/14~ 9/14 30,590. 9/12~ 9/14 10,693.	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. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	10/ 2~10/ 9 0. (10/ 9~10/16 0.)	気候変動対応支援資金供給 171,298 1/30~ 1/30 69,704. 7/18~ 7/21 101,594.
			国債買現先オペ		
			0	国債現先(米ドルオペ用担保) 0	
				国庫短期証券買入額(月初来)	
			国債売現先オペ	0	
			0		
		※直近約1週間の実施分を記載	国債買入額(固定利回)(月初来)	0	
			C P 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		
			社債買入額(月初来)	0	
			C P 等買入(推定)	3,900	
			社債等買入(推定)	34,900	
			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	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 2,893
			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 2,893
				差し引き	835,202

※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8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	壳気配	+0.400	1M	+0.609000	3M	買気配	+0.500
1W	壳気配	+0.400	2M	-----	6M	買気配	+0.650
2W	壳気配	+0.400	3M	-----	1Y	買気配	+0.800
1M	壳気配	+0.400					

<10月7日のコール市場残高(単位:億円)

	残高	増減
市場合計	111,794	+314
有担保	24,967	-332
無担保	86,827	+646

<10月8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				東京レポーレート	
	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	0.477	± 0			0.430	± 0	0.492	+0.003
トムネ				-----				-----	0.492	± 0
スボネ				-----				-----		
1週間物	0.478	0.610	0.509	+0.020				-----	0.484	+0.001
2週間物			0.470	± 0				-----	0.483	± 0
3週間物				-----				-----	0.483	+0.001
1ヶ月物				-----				-----	0.490	± 0
3ヶ月物			0.610	± 0				-----	0.556	+0.004
6ヶ月物				-----				-----	0.611	+0.005
1年物				-----				-----	0.716	+0.006

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。