

東京短資デイリーレポート

2025/10/20

<10月17日のマネタリーベース>

6,186,100

<10月20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	4,968,800
前日の日銀当座預金残高-①	4,974,100
日銀当座預金残高増減前日比	-5,300

<10月20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	-7,000	
資金過不足	-7,600	
金融調節		
期落	新規	
国債補完供給	+1,400	-2,000
金融調節合計		-600
当座預金増減-②		-8,200

<10月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,965,900
準備預金残高	4,513,400
積み終了先	4,507,100
超過準備	4,500,900
非準備預金残高	452,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,104,100
今積み期間所要準備額(平均)	132,400
残り要積立額(積数)	17,700
残り要積立額(平均)	700
準備進捗率(%)	99.5
日数進捗率(%)	16.1
進捗率乖離幅	+83.4

<10月21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	-100	
財政等要因	+100	
資金過不足	± 0	
金融調節確定分		
期落	新規	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+2,000	
金融調節合計		+1,900
当座預金増減		+1,900

<10月21日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残496兆7,800億円)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21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	5,012,800	+46,900
+40,000	5,007,800	+41,900
+35,000	5,002,800	+36,900
+30,000	4,997,800	+31,900
+25,000	4,992,800	+26,900
+20,000	4,987,800	+21,900
+15,000	4,982,800	+16,900
+10,000	4,977,800	+11,900
+5,000	4,972,800	+6,900
± 0	4,967,800	+1,900
-5,000	4,962,800	-3,100
-10,000	4,957,800	-8,100
-15,000	4,952,800	-13,100
-20,000	4,947,800	-18,100
-25,000	4,942,800	-23,100
-30,000	4,937,800	-28,100
-35,000	4,932,800	-33,100
-40,000	4,927,800	-38,100
-45,000	4,922,800	-43,100

<10月20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。

(11:50) 国債補完供給 25/10/20-25/10/21 応札 2,233億 落札 2,233億 全取 +0.25% 平均 +0.25%

(13:50) 国債補完供給 25/10/20-25/10/21 応札 0億 落札 0億

<10月20日 各オペ残高と内訳>

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	1,7,824	成長基盤強化支援資金供給	1,87
10/15~10/29	8,009.	10/17(1-3Y) 3,004. 13,546 6,28,760	11/17~11/17 0.
		10/17(3-5Y) 2,802. 12/1~12/1 2,464. 11/18~11/17 57.	
		10/17(5-10Y) 3,056. 12/4~12/4 842. 2/16~2/16 0.	
		10/17(25Y-) 750. 3/2~3/2 7,922. 3/16~3/16 38,879. 2/17~2/16 0.	
		3/4~3/4 830. 6/3~6/3 3,160. 6/18~6/18 18,695. 5/12~5/12 0.	
		6/3~6/3 2,384. 6/20~6/19 46,265. 9/14~9/14 30,590. 8/18~8/18 130.	
		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則	米ドル資金供給オペ
		4,056百万ドル	1百万ドル
		12/4~12/4 842. 10/16~10/23 1.	気候変動対応支援資金供給
		3/4~3/4 830. 1/30~1/30 69,704.	171,298
		6/3~6/3 2,384. 7/18~7/21 101,594.	
		国債買現先オペ	国債売現先(米ドルオペ用担保)
		0	0
		国債買現先オペ	国庫短期証券買入額(月初来)
		0	0
		CP買入額(月初来)	CP買入額(推定)
		0	3,800
		ETF買入額	CP等買入(推定)
		356,921	70,035
		約定 23/10/4 701.	社債等買入(推定)
		ETF買入額(企業支援)	国債買先 0
		14,628	被災地金融機関支援 187
		約定 21/3/31 12.	気候変動対応支援 171,298
		J-REIT買入額	成長基盤支援 12,791
		6,823	手形売出 0
		約定 22/6/14 12.	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 2,233
			貸出(推定) 0
			国債現先(米ドル担保) 0
			供給額合計 838,095
			吸収額合計 2,233
			差し引き 835,862

※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20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買気配 +0.5250003M 買気配 +0.500	
1W 売気配 +0.400	2M ----- 6M 買気配 +0.650	
2W 売気配 +0.400	3M買気配 +0.7300001Y 買気配 +0.800	
1M 売気配 +0.400		

<10月17日のJ-REIT市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高	増減
107,509	-779	
有担保	26,992	+374
無担保	80,517	-1,153

<10月20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	0.499	+0.002
トムネ							0.499	± 0
スボネ								
1週間物			0.590	+0.102			0.491	+0.001
2週間物	0.471	0.475	0.473	-----			0.492	+0.003
3週間物							0.491	+0.002
1ヶ月物							0.497	+0.001
3ヶ月物			0.630	-----			0.550	+0.002
6ヶ月物							0.614	+0.002
1年物							0.720	+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