

東京短資ティリーレポート

2025/10/28

<10月27日のマネタリーベース>

6,192,500

<10月28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	4,978,200
前日の日銀当座預金残高(①)	4,978,000
日銀当座預金残高増減前日比	+200

<10月28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	0	
財政等要因	+1,000	
資金過不足	+1,000	
金融調節		
期落	新規	
国債補完供給	+1,400	-1,200
金融調節合計		+200
当座預金増減(②)		+1,200

<10月28日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,979,200
準備預金残高	4,541,400
積み終了先	4,540,600
超過準備	4,540,600
非準預先残高	437,800

<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)	1,200
残り要積立額(平均)	100
準預進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+58.0

<10月29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	0	
財政等要因	-1,800	
資金過不足	-1,800	
金融調節確定分		
期落	新規	
国債買入	+7,900	
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
社債等買入	-100	
国債補完供給	+1,200	
金融調節合計		+9,000
当座預金増減		+7,200

<10月29日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残498兆6,400億円)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29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	5,031,400	+52,200
+40,000	5,026,400	+47,200
+35,000	5,021,400	+42,200
+30,000	5,016,400	+37,200
+25,000	5,011,400	+32,200
+20,000	5,006,400	+27,200
+15,000	5,001,400	+22,200
+10,000	4,996,400	+17,200
+5,000	4,991,400	+12,200
±0	4,986,400	+7,200
-5,000	4,981,400	+2,200
-10,000	4,976,400	-2,800
-15,000	4,971,400	-7,800
-20,000	4,966,400	-12,800
-25,000	4,961,400	-17,800
-30,000	4,956,400	-22,800
-35,000	4,951,400	-27,800
-40,000	4,946,400	-32,800
-45,000	4,941,400	-37,800

<10月28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(3Y~5Y)	25/10/29	2,800億	応札	6,086億	落札	2,803億	最低 -0.015%	平均 -0.013%
(10:10) 国債買入(5Y~10Y)	25/10/29	3,050億	応札	5,843億	落札	3,053億	最低 -0.025%	平均 -0.021%
(10:10) 国債買入(10Y~25Y)	25/10/29	1,150億	応札	3,112億	落札	1,154億	最低 -0.009%	平均 -0.008%
(10:10) 国債買入(25Y~)	25/10/29	750億	応札	2,214億	落札	751億	最低 +0.003%	平均 +0.006%
(10:10) 国債買入(物別)	25/10/29	500億	応札	2,085億	落札	500億	按分 -0.280円	平均 -0.345円
(10:40) 米ドル資金供給	25/10/30-25/11/6	0mil	応札	0mil	落札	0mil	貸付	4.150%
(11:50) 国債補完供給	25/10/28-25/10/29	1,291億	応札	1,291億	落札	1,291億	全取 +0.250%	平均 +0.250%
(13:00) 共通担保(全店)固	25/10/29-25/11/12	8,000億	応札	25,901億	落札	8,010億	貸付	0.500%
(13:50) 国債補完供給	25/10/28-25/10/29	0億	応札	0億	落札	0億		

<10月28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	8,009	国債買入額(月初来)	24,784	成長基盤強化支援資金供給	1,3546	貸出増加支援資金供給	628,760	被災地金融機関支援資金供給

10/15~10/29	8,009.	10/23(1~3Y)	3,004.	12/ 1~12/ 1	2,464.	12/15~12/15	20,129.	11/17~11/17	0.
(10/29~11/12	8,010.)	10/23(3~5Y)	2,803.	12/ 4~12/ 4	842.	12/13~12/15	33,838.	11/18~11/17	57.
		10/23(10~25Y)	1,153.	3/ 2~3/ 2	7,922.	3/16~3/16	38,879.	2/16~2/16	0.
		(10/29(3~5Y)	2,803.)	3/ 4~3/ 4	830.	3/17~3/16	18,695.	5/12~5/12	0.
		(10/29(5~10Y)	3,053.)	6/ 3~6/ 3	3,160.	6/18~6/18	70,188.	8/18~8/18	130.
		(10/29(10~25Y)	1,154.)	6/ 3~6/ 3	2,384.	6/20~6/19	46,265.		
		(10/29(物別)	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	米ドル資金供給オペ
成長基盤強化支援米ドル特則	0百万ドル
4,056百万ドル	
12/ 4~12/ 4	842.
3/ 4~3/ 4	830.
6/ 3~6/ 3	2,384.

共通担保(全店)金利入札	70,035	国債買入額(固定利回)(月初来)	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)

国債現先オペ	0	国債壳現先(米ドルオペ用担保)
		0
		国庫短期証券買入額(月初来)

国債壳現先オペ	0	CP 買入額(月初来)
		0
		CP 買入額(月初来)

ETF買入額	356,921	社債買入額(月初来)	0.	社債買入額(月初来)
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	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28日のオペン市場気配レート(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	0.525	0.477	±0			0.430	±0 0.494 -0.003
トムズ								
スボネ								
1週間物	0.487	0.550	0.516	-0.036				
2週間物	0.470	0.481	0.476	±0				
3週間物								
1ヶ月物								
3ヶ月物								
6ヶ月物								
1年物								

<10月27日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

市場合計	107,611	残高	+219