

東京短資ティリーレポート

2025/10/31

<10月30日のマネタリーベース>

6,204,100

<10月31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	4,985,600
前日の日銀当座預金残高-①	4,989,200
日銀当座預金残高増減前日比	-3,600

<10月31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	-11,400	
資金過不足	-11,300	
金融調節		
期落	新規	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+900	-1,600
金融調節合計		-800
当座預金増減-②		-12,100

<10月31日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,977,100
準備預金残高	4,532,200
積み終了先	4,532,200
超過準備	4,532,200
非準備預金残高	444,900

<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)	400
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	61.3
進捗率乖離幅	+38.6

<11月4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	-27,900	
資金過不足	-28,200	
金融調節確定分		
期落	新規	
国債補完供給	+1,600	
金融調節合計		+1,600
当座預金増減		-26,600

<11月4日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残495兆500億円)で
無担保コール0/NIは+0.471%~+0.477%での出合いが中心か。

<11月4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	4,995,500	+18,400
+40,000	4,990,500	+13,400
+35,000	4,985,500	+8,400
+30,000	4,980,500	+3,400
+25,000	4,975,500	-1,600
+20,000	4,970,500	-6,600
+15,000	4,965,500	-11,600
+10,000	4,960,500	-16,600
+5,000	4,955,500	-21,600
±0	4,950,500	-26,600
-5,000	4,945,500	-31,600
-10,000	4,940,500	-36,600
-15,000	4,935,500	-41,600
-20,000	4,930,500	-46,600
-25,000	4,925,500	-51,600
-30,000	4,920,500	-56,600
-35,000	4,915,500	-61,600
-40,000	4,910,500	-66,600
-45,000	4,905,500	-71,600

<10月31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 25/10/31-25/11/4 応札 1,644億 落札 1,644億 全取 +0.250% 平均 +0.250%

(13:50) 国債補完供給 25/10/31-25/11/4 応札 0億 落札 0億

8,010	33,045	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
10/29~11/12	8,010.	10/29(3~5Y) 2,803.	13,546	628,760
		10/29(5~10Y) 3,053.	12/1~12/1 2,464.	11/17~11/17 0.
		10/29(10~25Y) 1,154.	12/4~12/4 842.	11/18~11/17 57.
		10/29(25Y-) 751.	3/2~3/2 7,922.	2/16~2/16 0.
		10/29(物国) 500.	3/4~3/4 830.	2/17~2/16 0.
			6/3~6/3 3,160.	5/12~5/12 0.
			6/3~6/3 2,384.	8/18~8/18 130.

※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	4,056百万ドル	米ドル資金供給オペ	0百万ドル
12/4~12/4 842.	3/4~3/4 830.	10/30~11/6 0.	気候変動対応支援資金供給
6/3~6/3 2,384.			171,298
			1/30~1/30 69,704.
			7/18~7/21 101,594.
国債買現先オペ	0	国債売現先(米ドルオペ用担保)	0
			0
		国庫短期証券買入額(月初来)	
国債買現先オペ	0		
		CP買入額(月初来)	
0			
		CP買入額(月初来)	
0			
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

国債買入額(固定利回)(月初来)	0	CP等買入(推定)	2,100
		共通担保(全)金入	70,035
		社債等買入(推定)	33,200
		国債買現先	0
		被災地金融機関支援	187
		成長基盤支援	171,298
		貸出増加支援	575,775
		供給オペ合計	838,096
		貸出(推定)	0
		供給合計	838,096
		差し引き	836,452

※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31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 +0.600000	3M 買気配 +0.650
1W 売気配 +0.400	2M 買気配 +0.680000	06M 買気配 +0.650
2W 売気配 +0.400	3M 買気配 +0.720000	01Y 買気配 +0.800
1M 売気配 +0.400		

<10月30日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高	増減
103,409		-846
有担保	27,316	-605
無担保	76,093	-241

<10月31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	+0.001			0.430	±0 0.493 -0.003
トムネ								0.497 +0.016
スボネ								
1週間物								0.491 ±0 0
2週間物	0.471	0.600	0.518	+0.041			0.491	±0 0
3週間物					0.535	+0.005		0.491 ±0 0
1ヶ月物	0.530	0.600	0.556	-0.003			0.493	-0.002
3ヶ月物							0.566	-0.005
6ヶ月物							0.629	-0.003
1年物							0.737	±0

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