

東京短資デイリーレポート

2025/10/3

<10月2日のマネタリーベース>

6,162,100

<10月3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	4,923,900
前日の日銀当座預金残高-①	4,948,400
日銀当座預金残高増減前日比	-24,500

<10月3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	-25,600
資金過不足	-25,800
金融調節	
国債補完供給	+3,400
金融調節合計	+2,100
当座預金増減-②	-23,700

<10月3日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,924,700
準備預金残高	4,467,800
積み終了先	4,467,700
超過準備	4,467,700
非準備先残高	456,900

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	3,983,200
今積み期間所要準備額 (平均)	132,800
残り要積立額 (積数)	200
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	66.7
進捗率乖離幅	+33.2

<10月6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	+700
財政等要因	+900
資金過不足	+1,600
金融調節確定分	
国債補完供給	+1,300
金融調節合計	+1,300
当座預金増減	+2,900

<10月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残492兆7,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<10月6日9時20分の日銀当座預金状況>

9時20分の日銀オペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	4,972,600	+47,900
+40,000	4,967,600	+42,900
+35,000	4,962,600	+37,900
+30,000	4,957,600	+32,900
+25,000	4,952,600	+27,900
+20,000	4,947,600	+22,900
+15,000	4,942,600	+17,900
+10,000	4,937,600	+12,900
+5,000	4,932,600	+7,900
± 0	4,927,600	+2,900
-5,000	4,922,600	-2,100
-10,000	4,917,600	-7,100
-15,000	4,912,600	-12,100
-20,000	4,907,600	-17,100
-25,000	4,902,600	-22,100
-30,000	4,897,600	-27,100
-35,000	4,892,600	-32,100
-40,000	4,887,600	-37,100
-45,000	4,882,600	-42,100

<10月3日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	25/10/ 3-25/10/ 6	応札 1,336億 落札 1,333億 全取 +0.250% 平均 +0.249%
(13:50) 国債補完供給	25/10/ 3-25/10/ 6	応札 5億 落札 5億 全取 +0.250% 平均 +0.250%

<10月3日 各オペ残高と内訳>

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初末)	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	187
10/ 1-10/15 8,009.	9/30(3-5Y) 3,257.	1 3,546	6 28,760
	9/30(5-10Y) 3,504.	12/ 1-12/ 1 2,464.	12/15-12/15 20,129.
	9/30(25Y-) 751.	12/ 4-12/ 4 842.	12/13-12/15 33,838.
	9/30(物国) 500.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/16~ 3/16 38,879.
		3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.
		6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 70,188.
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/20~ 6/19 46,265.
			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	※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別	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.	
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	
		国債買現先オペ	0
		0	国債売現先(米ドルオペ用担保)
			0
		国債売現先オペ	0
		0	国庫短期証券買入額(月初末)
			0
		※直近約1週間の実施分を記載	
		国債買入額(固定利回)(月初末)	0
		0	
		CP買入額(月初末)	0
		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.	

※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3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 +0.631000	3M 買気配 +0.550	
1W 売気配 +0.400	2M +0.700000	6M 買気配 +0.550	
2W 売気配 +0.400	3M +0.760000	1Y 買気配 +0.800	
1M 売気配 +0.400			

<10月2日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	105,357	+454
有担保	25,091	+463
無担保	80,266	-9

<10月3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	平均値	前日比
翌日物	0.445	0.478	0.477	± 0			0.430	± 0	0.491	± 0
トムネ				-----				-----	0.494	+0.003
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.525	0.550	0.542	-0.003				-----	0.483	± 0
2週間物	0.470	0.478	0.474	-0.003				-----	0.482	-0.001
3週間物				-----				-----	0.482	-0.001
1ヶ月物	0.540	0.590	0.565	-----				-----	0.486	± 0
3ヶ月物			0.710	-----				-----	0.581	+0.010
6ヶ月物				-----				-----	0.620	+0.010
1年物				-----				-----	0.723	+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