

東京短資デイリーレポート

2025/10/17

<10月16日のマネタリーベース>

6,172,600

<10月17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	4,974,800
前日の日銀当座預金残高-①	4,960,700
日銀当座預金残高増減前日比	+14,100

<10月17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	+3,900
資金過不足	+3,700
金融調節	
国債買入	期落 新規
国債買入	+9,500
国債補完供給	+1,600 -1,400
金融調節合計	+9,700
当座預金増減-②	+13,400

<10月17日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,974,100
準備預金残高	4,523,600
積み終了先	4,498,400
超過準備	4,292,000
非準備先残高	450,500

<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)	30,200
残り要積立額(平均)	1,100
準備進捗率(%)	99.2
日数進捗率(%)	12.9
進捗率乖離幅	+86.3

<10月20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	-600
財政等要因	-6,100
資金過不足	-6,700
金融調節確定分	
国債補完供給	期落 新規
国債補完供給	+1,400
金融調節合計	+1,400
当座預金増減	-5,300

<10月20日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残496兆8,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.471%~+0.477% での合いが中心か。

<10月20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	5,013,800	+39,700
+40,000	5,008,800	+34,700
+35,000	5,003,800	+29,700
+30,000	4,998,800	+24,700
+25,000	4,993,800	+19,700
+20,000	4,988,800	+14,700
+15,000	4,983,800	+9,700
+10,000	4,978,800	+4,700
+5,000	4,973,800	-300
±0	4,968,800	-5,300
-5,000	4,963,800	-10,300
-10,000	4,958,800	-15,300
-15,000	4,953,800	-20,300
-20,000	4,948,800	-25,300
-25,000	4,943,800	-30,300
-30,000	4,938,800	-35,300
-35,000	4,933,800	-40,300
-40,000	4,928,800	-45,300
-45,000	4,923,800	-50,300

<10月17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	25/10/17-25/10/20	応札 1,539億 落札 1,539億 全取 +0.250% 平均 +0.250%
(13:50) 国債補完供給	25/10/17-25/10/20	応札 0億 落札 0億

<10月17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	17,824	成長基盤強化支援資金供給 貸出増加支援資金供給	187
10/15-10/29 8,009.	10/17(1-3Y) 3,004. 10/17(3-5Y) 2,802. 10/17(5-10Y) 3,056. 10/17(25Y-) 750.	13,546 628,760 12/ 1~12/ 1 2,464. 12/15-12/15 20,129. 12/ 4~12/ 4 842. 12/13-12/15 33,838. 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.	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.
共通担保(全店)金利入札	70,035	※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	気候変動対応支援資金供給
1/24~ 1/24 10,003. 2/ 1~ 2/ 1 10,004. 2/15~ 2/15 10,004. 3/ 1~ 3/ 1 10,010. 9/15~ 9/15 10,005. 10/10-10/10 10,006. 10/25-10/25 10,003.	0	4,056百万ドル 1百万ドル 12/ 4~12/ 4 842. 10/16-10/23 1. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	171,298 1/30~ 1/30 69,704. 7/18~ 7/21 101,594.
国債補完供給	1,539	国債買現先オペ	国債売現先(米ドルオペ用担保)
10/17-10/20 1,539. 10/17-10/20 0.	0	0	0
ETF買入額	356,921	国債売現先オペ	国債短期証券買入額(月初末)
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	14,628	0	0
約定 21/ 3/31 12. J-REIT買入額	6,823	CP買入額(月初末)	0
約定 22/ 6/14 12.	0	0	0

<10月17日 日銀信用概算(除く買切)>			
共通担保(全)固定	8,009	CP等買入(推定)	3,800
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	34,600
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	1,539
貸出(推定)	0	国債売現先(米ドル担保)	0
供給額合計	838,095	吸収額合計	1,539
	差し引き		836,556

※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17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 -----	3M 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 -----	1Y 買気配 +0.800			
1M 売気配 +0.400					

<10月16日のJ-レポ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	108,288	+1,820
有担保	26,618	+177
無担保	81,670	+1,643

<10月17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	0.450	0.478	0.477	±0			0.430	±0	0.497	+0.003
トムネ				-----				-----	0.499	+0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.478	0.560	0.488	-0.062				-----	0.490	+0.001
2週間物				-----				-----	0.489	+0.001
3週間物			0.475	-0.050				-----	0.489	±0
1ヶ月物				-----				-----	0.496	+0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.548	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.612	-0.001
1年物				-----				-----	0.718	+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