

東京短資デイリー・レポート

2025/10/21

<10月20日のマネタリーベース>

6,178,600

<10月21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	4,967,800
前日の日銀当座預金残高-①	4,965,900
日銀当座預金残高増減前日比	+1,900

<10月21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	-3,700
資金過不足	-3,800

金融調節		期落	新規
社債等買入		-100	
国債補完供給		+2,000	-1,300
金融調節合計			+600
当座預金増減(②)			-3,200

<10月21日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (1)+(2)	4,962,700
準備預金残高	4,505,600
積み終了先	4,503,000
超過準備	4,500,900
非準預金残高	457,100

<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）	13,000
残り要積立額（平均）	500
準預進捲率（%）	99.6
日數進捲率（%）	19.4
進捲率乖離幅	+80.2

＜10月22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	-200
財政等要因	-2,000
資金過不足	-2,200
金融調節確定分	
CP等買入	期落 -300
国債補完供給	+1,300
金融調節合計	+1,000
当座預金増減	-1,200

<10月22日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残496兆1,500億円)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22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	5,006,500	+43,800
+40,000	5,001,500	+38,800
+35,000	4,996,500	+33,800
+30,000	4,991,500	+28,800
+25,000	4,986,500	+23,800
+20,000	4,981,500	+18,800
+15,000	4,976,500	+13,800
+10,000	4,971,500	+8,800
+5,000	4,966,500	+3,800
± 0	4,961,500	-1,200
-5,000	4,956,500	-6,200
-10,000	4,951,500	-11,200
-15,000	4,946,500	-16,200
-20,000	4,941,500	-21,200
-25,000	4,936,500	-26,200
-30,000	4,931,500	-31,200
-35,000	4,926,500	-36,200
-40,000	4,921,500	-41,200
-45,000	4,916,500	-46,200

<10月21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月21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)

※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。共同担保・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、毎回前回返済による減少があるため、貸付額の会計上とは必ずしも一致しません。

合資金供給額への賃付残高は、期日前返済による減少

10月22日のオープン市場気配率レート(単位:%)						
NCD/CP現先	CPブライマリ	TBアウトライト				
S/N	壳気配 +0.400	1M +0.700000	3M	買気配 +0.500		
1W 壳気配 +0.400	2M +0.720000	6M	買気配 +0.650			
2W 壳気配 +0.400	3M -----	1Y	買気配 +0.800			
1M 壳気配 +0.400						

＜10月20日のコ-ル市場残高(単位:億円)		
	残高	増減
市場合計	109,989	+2,480
有担保	26,976	-16
無担保	82,013	+2,406

＜10月21日のコニル市場レート速報と東京レポ・レート（単位：%）＞

東京レポート										
無担保コール				有担保コール						
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	0.525	0.477	± 0			0.430	± 0	0.497	-0.002
トムネ				-----				-----	0.497	-0.002
スボネ				-----				-----		
1週間物	0.485	0.510	0.492	-0.098				-----	0.491	± 0
2週間物	0.470	0.481	0.476	+0.003				-----	0.493	+0.001
3週間物				-----				-----	0.492	+0.001
1ヶ月物				-----				-----	0.497	± 0
3ヶ月物				-----				-----	0.562	+0.012
6ヶ月物				-----				-----	0.618	+0.004
1年物				-----				-----	0.726	+0.006

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。

購入対価のみお支払いただきます。

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。