東京短資デイリーレポート　2026/10/20

＜10月19日のマネタリーベース＞

5,358,400

＜10月20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	4,190,000
前日の日銀当座預金残高-①	4,173,400
日銀当座預金残高増減前日比	+16,600

＜10月20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		+10,800
資金過不足		+10,700
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+300	-400
金融調節合計		-100
当座預金増減-②		+10,600

＜10月20日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高 （①+②）	4,184,000
準備預金残高	3,865,500
積み終了先	3,843,000
超過準備	3,841,800
非準預先残高	318,500

＜参考＞

今積み期間所要準備額（積数）	4,163,000
今積み期間所要準備額（平均）	134,300
残り要積立額（積数）	68,100
残り要積立額（平均）	2,600
準預進捗率(%)	98.3
日数進捗率(%)	16.1
進捗率乖離幅	+82.2

＜10月21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		-400
財政等要因		-13,100
資金過不足		-13,500
金融調節確定分		
	期落	新規
社債等買入	-200	
国債補完供給	+400	
金融調節合計		+200
当座預金増減		-13,300

＜10月21日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残417兆700億円)で
無担保コール0/Nは+1.226%～+1.228%
での出合いが中心か。

＜10月21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	4,215,700	+31,700
+40,000	4,210,700	+26,700
+35,000	4,205,700	+21,700
+30,000	4,200,700	+16,700
+25,000	4,195,700	+11,700
+20,000	4,190,700	+6,700
+15,000	4,185,700	+1,700
+10,000	4,180,700	-3,300
+5,000	4,175,700	-8,300
± 0	4,170,700	-13,300
-5,000	4,165,700	-18,300
-10,000	4,160,700	-23,300
-15,000	4,155,700	-28,300
-20,000	4,150,700	-33,300
-25,000	4,145,700	-38,300
-30,000	4,140,700	-43,300
-35,000	4,135,700	-48,300
-40,000	4,130,700	-53,300
-45,000	4,125,700	-58,300

＜10月20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。

(10:40) 米ドル資金供給	26/10/22-26/10/29		応札	2mil 落札	2mil	貸付 4.130%
(11:50) 国債補完供給	26/10/20-26/10/21		応札	382億 落札	382億 全取 +0.800% 平均 +0.800%	
(13:50) 国債補完供給	26/10/20-26/10/21		応札	0億 落札	0億	
(14:45) 米ドルオペ用担保供給	26/10/21-26/10/30	5,000億	応札	2億 落札	2億 全取 +1.220% 平均 +1.220%	

＜10月20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(月初来)	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
0	9,664	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	117
	10/19(3-5Y) 2,904.	0	365,359	11/17~11/17 0.
	10/19(10-25Y) 851.		12/14~12/14 36,712.	2/16~ 2/16 0.
	10/19(25Y-) 752.		12/15~12/14 5,876.	5/12~ 5/12 0.
			3/17~ 3/17 78,260.	8/18~ 8/18 117.
			6/19~ 6/18 59,459.	
			9/15~ 9/15 35,448.	
共通担保(全店)変動金利			12/15~12/15 51,094.	
8,009			3/18~ 3/17 98,510.	
10/14~10/28 8,009.		※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則	米ドル資金供給オペ	
		0百万ﾄﾞﾙ	0百万ﾄﾞﾙ	
			10/15~10/22 0.	気候変動対応支援資金供給
共通担保(全店)金利入札			(10/22~10/29 2.)	249,364
70,035				1/30~ 2/ 1 109,552.
1/24~ 1/24 10,003.				7/21~ 7/21 139,812.
2/ 1~ 2/ 1 10,004.				
2/15~ 2/15 10,004.		国債買現先オペ		
3/ 1~ 3/ 1 10,010.		0	国債売現先(米ドルオペ用担保)	
9/15~ 9/15 10,005.			0	
10/10~10/10 10,006.			(10/21~10/30 2.)	
10/25~10/25 10,003.				
			国庫短期証券買入額(月初来)	
		国債売現先オペ	0	
	※直近約1週間の実施分を記載	0		
	国債買入額(固定利回)(月初来)			
	0			
国債補完供給				
382				
10/20~10/21 382.		ＣＰ買入額(月初来)		
10/20~10/21 0.		0		
ETF買入額				
356,921				
約定 23/10/ 4 701.		社債買入額(月初来)		
ETF買入額(企業支援)		0		
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			

＜10月20日 日銀信用概算(除く買切)＞

共通担保(全)固定	0	CP等買入(推定)	0
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	9,900
共通担保(全)変動	8,009		
国債買現先	0		
被災地金融機関支援	117		
気候変動対応支援	249,361	手形売出	0
貸出増加支援	356,645	国債売現先	0
供給オペ合計	684,167	国債補完供給	382
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	684,167	吸収額合計	382
差し引き	683,785		

※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20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 +1.150	1M	+1.290000	3M	買気配 +1.300
1W	売気配 +1.150	2M	+1.420000	6M	買気配 +1.450
2W	売気配 +1.150	3M	+1.455000	1Y	買気配 +1.670
1M	売気配 +1.150				

＜10月19日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)＞

	残高	増減
市場合計	128,555	-1,677
有担保	23,964	+1,187
無担保	104,591	-2,864

＜10月20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	1.201	1.280	1.228	+0.001			1.180	± 0	1.250	± 0
トムネ			1.215	------				------	1.250	± 0
スポネ				------				------		
1週間物	1.225	1.310	1.232	+0.006				------	1.250	± 0
2週間物	1.228	1.290	1.230	------				------	1.250	± 0
3週間物				------				------	1.250	± 0
1ヶ月物				------				------	1.255	+0.001
3ヶ月物	1.510	1.520	1.513	------				------	1.325	+0.003
6ヶ月物				------				------	1.442	+0.001
1年物				------				------	1.646	± 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