東京短資デイリーレポート　2026/10/28

＜10月27日のマネタリーベース＞

5,369,800

＜10月28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	4,182,900
前日の日銀当座預金残高-①	4,182,700
日銀当座預金残高増減前日比	+200

＜10月28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		-2,100
資金過不足		-2,200
金融調節		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
社債等買入	-100	
国債補完供給	+400	-300
金融調節合計		± 0
当座預金増減-②		-2,200

＜10月28日の日銀当座預金状況＞

当座預金残高 (①+②)	4,180,500
準備預金残高	3,863,200
積み終了先	3,863,100
超過準備	3,863,100
非準預先残高	317,300

＜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）	700
残り要積立額（平均）	0
準預進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	41.9
進捗率乖離幅	+58.0

＜10月29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		-500
財政等要因		+8,100
資金過不足		+7,600
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+6,000
社債等買入	-100	
国債補完供給	+300	
金融調節合計		+6,200
当座預金増減		+13,800

＜10月29日のオペ予想＞

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残419兆4,300億円)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29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	4,239,300	+58,800
+40,000	4,234,300	+53,800
+35,000	4,229,300	+48,800
+30,000	4,224,300	+43,800
+25,000	4,219,300	+38,800
+20,000	4,214,300	+33,800
+15,000	4,209,300	+28,800
+10,000	4,204,300	+23,800
+5,000	4,199,300	+18,800
± 0	4,194,300	+13,800
-5,000	4,189,300	+8,800
-10,000	4,184,300	+3,800
-15,000	4,179,300	-1,200
-20,000	4,174,300	-6,200
-25,000	4,169,300	-11,200
-30,000	4,164,300	-16,200
-35,000	4,159,300	-21,200
-40,000	4,154,300	-26,200
-45,000	4,149,300	-31,200

＜10月28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。

(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	26/10/29	2,900億	応札	6,666億	落札	2,908億 最低 +0.031% 平均 +0.033% 按分 44.9%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	26/10/29	3,050億	応札	6,161億	落札	3,052億 最低 +0.038% 平均 +0.041% 按分 82.9%
(10:10) 国債買入(物国)	26/10/29	300億	応札	1,536億	落札	300億 按分-0.560円 平均-0.590円 按分 63.2%
(11:50) 国債補完供給	26/10/28-26/10/29		応札	331億	落札	331億 全取 +0.800% 平均 +0.800%
(13:50) 国債補完供給	26/10/28-26/10/29		応札	0億	落札	0億

＜10月28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	１６，７８１	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	１１７
	10/22(1-3Y) 3,304.	0	３６５，３５９	11/17~11/17 0.
	10/22(5-10Y) 3,059.		12/14~12/14 36,712.	2/16~ 2/16 0.
	10/22(25Y-) 754.		12/15~12/14 5,876.	5/12~ 5/12 0.
	(10/29(3-5Y) 2,908.)		3/17~ 3/17 78,260.	8/18~ 8/18 117.
	(10/29(5-10Y) 3,052.)		6/19~ 6/18 59,459.	
	(10/29(物国) 300.)		9/15~ 9/15 35,448.	
共通担保(全店)変動金利			12/15~12/15 51,094.	
８，００４			3/18~ 3/17 98,510.	
10/28~11/11 8,004.		※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	２百万ﾄﾞﾙ	
			10/22~10/29 2.	気候変動対応支援資金供給
共通担保(全店)金利入札			(10/29~11/ 6 0.)	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.			２	
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				
３３１				
10/28~10/29 331.		ＣＰ買入額(月初来)		
10/28~10/29 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28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)	9,600
共通担保(全)変動	8,004		
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	684,162	国債補完供給	331
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	2
供給額合計	684,162	吸収額合計	333
差し引き	683,829		

※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28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	+1.421000	3M	買気配 +1.300
1W	売気配 +1.150	2M	+1.460000	6M	買気配 +1.400
2W	売気配 +1.150	3M	+1.650000	1Y	買気配 +1.650
1M	売気配 +1.150				

＜10月27日のｺｰﾙ市場残高(単位:億円)

	残高	増減
市場合計	124,736	+462
有担保	23,103	+417
無担保	101,633	+45

＜10月28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	1.203	1.275	1.227	± 0			1.180	± 0	1.250	± 0
トムネ			1.220	-0.008				------	1.250	± 0
スポネ				------				------		
1週間物	1.231	1.340	1.271	± 0				------	1.250	± 0
2週間物			1.310	+0.070				------	1.250	± 0
3週間物				------				------	1.250	± 0
1ヶ月物			1.340	± 0				------	1.253	+0.001
3ヶ月物	1.520	1.570	1.541	------				------	1.336	+0.003
6ヶ月物				------				------	1.444	+0.002
1年物				------				------	1.647	+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