

# 東京短資デイリーレポート

2026/1/5

## <12月30日のマネタリーベース>

5,962,100
-----------

## <1月5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	4,703,400
前日の日銀当座預金残高-①	4,709,700
日銀当座預金残高増減前日比	-6,300

## <1月5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		+2,200
財政等要因		+4,300
資金過不足		+6,500
金融調節		
	期落	新規
国債補完供給	+1,700	-3,500
金融調節合計		-1,800
当座預金増減-②		+4,700

## <1月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,714,400
準備預金残高	4,313,900
積み終了先	4,313,900
超過準備	4,313,600
非準備先残高	400,500

## <参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,132,600
今積み期間所要準備額 (平均)	133,300
残り要積立額 (積数)	100
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	67.7
進捗率乖離幅	+32.2

## <1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		+3,500
財政等要因		-6,800
資金過不足		-3,300
金融調節確定分		
	期落	新規
国債補完供給	+3,500	
金融調節合計		+3,500
当座預金増減		+200

## <1月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残471兆4,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。
---

## <1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	4,759,600	+45,200
+40,000	4,754,600	+40,200
+35,000	4,749,600	+35,200
+30,000	4,744,600	+30,200
+25,000	4,739,600	+25,200
+20,000	4,734,600	+20,200
+15,000	4,729,600	+15,200
+10,000	4,724,600	+10,200
+5,000	4,719,600	+5,200
± 0	4,714,600	+200
-5,000	4,709,600	-4,800
-10,000	4,704,600	-9,800
-15,000	4,699,600	-14,800
-20,000	4,694,600	-19,800
-25,000	4,689,600	-24,800
-30,000	4,684,600	-29,800
-35,000	4,679,600	-34,800
-40,000	4,674,600	-39,800
-45,000	4,669,600	-44,800

## <1月5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	26/ 1/ 5-26/ 1/ 6	応札 3,404億 落札 3,404億 全取 +0.550% 平均 +0.550%
(13:50) 国債補完供給	26/ 1/ 5-26/ 1/ 6	応札 300億 落札 300億 全取 +0.550% 平均 +0.550%

## <1月5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
8,003	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
12/24~ 1/ 7 8,003.		11,082	580,669
		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.
			12/14~12/14 36,712.
			12/15~12/14 5,876.
		※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
		3,214百万ドル	0百万ドル
		3/ 4~ 3/ 4 830.	12/26~ 1/ 8 0.
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	
		国債買入先オペ	0
		0	国債売入先(米ドルオペ用担保)
			0
		国債売入先オペ	0
		0	0
		※直近約1週間の実施分を記載	※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	
		国債補完供給	3,704
		1/ 5~ 1/ 6 3,404.	
		1/ 5~ 1/ 6 300.	
		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.	
		※直近約1週間の実施分を記載	

<1月5日 日銀信用概算(除く買切)>			
共通担保(全)固定	8,003	CP等買入(推定)	300
共通担保(全)金入	70,035	社債等買入(推定)	27,200
国債買入先	0		
被災地金融機関支援	130		
気候変動対応支援	171,298		
成長基盤支援	10,414	手形売出	0
貸出増加支援	535,328	国債売入先	0
供給オペ合計	795,208	国債補完供給	3,704
貸出(推定)	0	国売現(米ドル担保)	0
供給額合計	795,208	吸収額合計	3,704
	差し引き		791,504

※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。

## <1月5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	+0.650	1M +0.805000	3M 買気配 +0.750
1W 売気配	+0.650	2M +0.860000	6M 買気配 +0.850
2W 売気配	+0.650	3M -----	1Y 買気配 +0.850
1M 売気配	+0.650		

## <12月30日のJ-レボ市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	99,108	+119
有担保	23,118	-973
無担保	75,990	+1,092

## <1月5日のコール市場レート速報と東京レボ・レート(単位:%)>

	無担保コール				有担保コール				東京レボレート	
	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	0.700	0.780	0.727	± 0			0.680	± 0	0.742	-0.005
トムネ				-----				-----	0.750	-0.002
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.734	0.860	0.793	-----				-----	0.739	+0.002
2週間物	0.785	0.870	0.805	+0.075				-----	0.736	+0.003
3週間物			0.850	-----				-----	0.736	+0.003
1ヶ月物	0.780	0.840	0.810	+0.010				-----	0.738	+0.003
3ヶ月物				-----				-----	0.744	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.772	+0.006
1年物				-----				-----	0.881	+0.003

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