

東京短資デイリーレポート

2026/1/6

<1月5日のマナリーベース>

5,964,600

<1月6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	4,714,600
前日の日銀当座預金残高-①	4,714,400
日銀当座預金残高増減前日比	+200

<1月6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		+3,700
財政等要因		+2,200
資金過不足		+5,900
金融調節		
国債補完供給	+2,100	-3,000
金融調節合計		-900
当座預金増減-②		+5,000

<1月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,719,400
準備預金残高	4,322,500
積み終了先	4,322,400
超過準備	4,322,400
非準備先残高	396,900

<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(%)	71.0
進捗率乖離幅	+28.9

<1月7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		+2,700
財政等要因		-60,000
資金過不足		-57,300
金融調節確定分		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+3,000	
金融調節合計		+3,000
当座預金増減		-54,300

<1月7日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残466兆5,100億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。

<1月7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	4,710,100	-9,300
+40,000	4,705,100	-14,300
+35,000	4,700,100	-19,300
+30,000	4,695,100	-24,300
+25,000	4,690,100	-29,300
+20,000	4,685,100	-34,300
+15,000	4,680,100	-39,300
+10,000	4,675,100	-44,300
+5,000	4,670,100	-49,300
± 0	4,665,100	-54,300
-5,000	4,660,100	-59,300
-10,000	4,655,100	-64,300
-15,000	4,650,100	-69,300
-20,000	4,645,100	-74,300
-25,000	4,640,100	-79,300
-30,000	4,635,100	-84,300
-35,000	4,630,100	-89,300
-40,000	4,625,100	-94,300
-45,000	4,620,100	-99,300

<1月6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/ 1/ 8-26/ 1/15	応札 0m1 落札 0m1	貸付 3.890%
(11:50) 国債補完供給	26/ 1/ 6-26/ 1/ 7	応札 3,216億 落札 3,216億 全取 +0.550% 平均 +0.550%	
(13:00) 共通担保(全)固	26/ 1/ 7-26/ 1/21	8,000億 応札 12,550億 落札 8,005億	貸付 0.750% 按分 63.8%
(13:50) 国債補完供給	26/ 1/ 6-26/ 1/ 7	応札 50億 落札 50億 全取 +0.550% 平均 +0.550%	

<1月6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	130
12/24~ 1/ 7 8,003. (1/ 7~ 1/21 8,005.)		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.	(1/ 8~ 1/15 0.)
			気候変動対応支援資金供給
			171,298
			1/30~ 1/30 69,704.
			7/18~ 7/21 101,594.
		国債買入先オペ	
		0	
		国債売先(米ドルオペ用担保)	
		0	
		国庫短期証券買入額(月初末)	
		0	
		国債売先先オペ	
		0	
		※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	
		CP買入額(月初末)	
		0	
		社債買入額(月初末)	
		0	

国債補完供給	3,266
1/ 6~ 1/ 7 3,216.	
1/ 6~ 1/ 7 50.	
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

※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6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	1M	+0.805000	3M	買気配 +0.750
1W	売気配 +0.650	2M	-----	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				

<1月5日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	104,778	+5,670
有担保	25,904	+2,786
無担保	78,874	+2,884

<1月6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	0.700	0.728	0.727	± 0			0.680	± 0	0.731	-0.011
トムネ				-----				-----	0.749	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.731	0.732	0.732	-0.061				-----	0.739	± 0
2週間物	0.710	0.730	0.726	-0.079				-----	0.738	+0.002
3週間物				-----				-----	0.738	+0.002
1ヶ月物	0.780	0.920	0.793	-0.017				-----	0.739	+0.001
3ヶ月物	0.810	0.880	0.866	-----				-----	0.746	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.776	+0.004
1年物				-----				-----	0.884	+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