

東京短資デイリーレポート

2026/2/5

<2月4日のマナリーベース>

5,762,600

<2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	4,556,800
前日の日銀当座預金残高-①	4,545,000
日銀当座預金残高増減前日比	+11,800

<2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	0
財政等要因	+4,800
資金過不足	+4,800
金融調節	
国債買入	期落 新規
	+6,900
国債補完供給	+2,300 -2,500
金融調節合計	+6,700
当座預金増減-②	+11,500

<2月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,556,500
準備預金残高	4,195,000
積み終了先	4,194,900
超過準備	4,194,900
非準備先残高	361,500

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,133,500
今積み期間所要準備額(平均)	133,300
残り要積立額(積数)	200
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

<2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	+600
財政等要因	-14,600
資金過不足	-14,000
金融調節確定分	
国債補完供給	期落 新規
	+2,500
金融調節合計	+2,500
当座預金増減	-11,500

<2月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残454兆5,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。

<2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	4,590,000	+33,500
+40,000	4,585,000	+28,500
+35,000	4,580,000	+23,500
+30,000	4,575,000	+18,500
+25,000	4,570,000	+13,500
+20,000	4,565,000	+8,500
+15,000	4,560,000	+3,500
+10,000	4,555,000	-1,500
+5,000	4,550,000	-6,500
±0	4,545,000	-11,500
-5,000	4,540,000	-16,500
-10,000	4,535,000	-21,500
-15,000	4,530,000	-26,500
-20,000	4,525,000	-31,500
-25,000	4,520,000	-36,500
-30,000	4,515,000	-41,500
-35,000	4,510,000	-46,500
-40,000	4,505,000	-51,500
-45,000	4,500,000	-56,500

<2月5日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	26/ 2/ 5-26/ 2/ 6	応札 2,700億 落札 2,700億 全取 +0.450% 平均 +0.447%
(13:50) 国債補完供給	26/ 2/ 5-26/ 2/ 6	応札 0億 落札 0億

<2月5日 各オペ残高と内訳>

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			
8,007		7,114		成長基盤強化支援資金供給		貸出増加支援資金供給		130	
2/ 4~ 2/18	8,007.	1/30(3-5Y)	2,453.	1 1,082	580,669	2/16~ 2/16	0.		
		1/30(5-10Y)	2,607.	3/ 2~ 3/ 2	7,922.	2/17~ 2/16	0.		
		1/30(10-25Y)	954.	3/ 4~ 3/ 4	830.	5/12~ 5/12	0.		
		1/30(物国)	400.	6/ 3~ 6/ 3	3,160.	8/18~ 8/18	130.		
		2/ 5(-1Y)	1,001.	6/ 3~ 6/ 3	2,384.	11/17~11/17	0.		
		2/ 5(1-3Y)	2,703.	6/20~ 6/19	46,265.				
		2/ 5(3-5Y)	2,454.	9/14~ 9/14	30,590.				
		2/ 5(10-25Y)	956.	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					
共通担保(全店)金利入札		70,035		成長基盤強化支援米ドル特則		米ドル資金供給オペ		3,214百万ドル	
1/24~ 1/24	10,003.	3/ 4~ 3/ 4	830.	2/ 5~ 2/13		3.		気候変動対応支援資金供給	
2/ 1~ 2/ 1	10,004.	6/ 3~ 6/ 3	2,384.					211,146	
2/15~ 2/15	10,004.	国債買現先オペ		0		国債売現先(米ドルオペ用担保)		7/18~ 7/21 101,594.	
3/ 1~ 3/ 1	10,010.	0		0		2/ 4~ 2/16		2.	
9/15~ 9/15	10,005.	国債売現先オペ		0		国庫短期証券買入額(月初末)		1/30~ 2/ 1 109,552.	
10/10~10/10	10,006.	0		0					
10/25~10/25	10,003.	0		0					
※直近約1週間の実施分を記載				CP買入額(月初末)		0			
国債補完供給		2,700		0					
2/ 5~ 2/ 6	2,700.	ETF買入額		356,921					
2/ 5~ 2/ 6	0.	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				社債買入額(月初末)		0			
		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				CP買入額(月初末)		0			
		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				社債買入額(月初末)		0			

※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。

<2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	1M	+0.850000	3M	買気配 +0.800
1W	売気配 +0.650	2M	0.000000	6M	買気配 +0.900
2W	売気配 +0.650	3M	+1.044000	1Y	買気配 +1.050
1M	売気配 +0.650				

<2月4日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	121,805	-12,063
有担保	24,452	-156
無担保	97,353	-11,907

<2月5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	0.780	0.727	±0			0.680	±0	0.744	-0.003
トムネ				-----				-----	0.749	+0.003
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.780	0.785	0.782	+0.013				-----	0.746	±0
2週間物	0.720	0.731	0.727	-0.033				-----	0.746	±0
3週間物				-----				-----	0.746	±0
1ヶ月物	0.840	0.920	0.870	+0.061				-----	0.748	+0.001
3ヶ月物	0.910	0.950	0.934	-----				-----	0.771	+0.001
6ヶ月物				-----				-----	0.834	+0.004
1年物				-----				-----	0.953	+0.004

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