

# 東京短資デイリーレポート

2025/2/7

## <2月6日のマナリーベース>

6,425,400
-----------

## <2月7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	5,177,900
前日の日銀当座預金残高-①	5,179,400
日銀当座預金残高増減前日比	-1,500

## <2月7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		+900
財政等要因		-600
資金過不足		+300
金融調節		
	期落	新規
社債等買入	-200	
国債補充供給	+3,700	-6,500
金融調節合計		-3,000
当座預金増減-②		-2,700

## <2月7日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,176,700
準備預金残高	4,664,600
積み終了先	4,664,300
超過準備	4,664,200
非準備先残高	512,100

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,082,300
今積み期間所要準備額(平均)	131,700
残り要積立額(積数)	2,000
残り要積立額(平均)	300
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	80.6
進捗率乖離幅	+19.3

## <2月10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		+900
財政等要因		+2,000
資金過不足		+2,900
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+9,200
国債補充供給	+6,500	
金融調節合計		+15,700
当座預金増減		+18,600

## <2月10日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残519兆5,300億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での合いが中心か。
---

## <2月10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	5,240,300	+63,600
+40,000	5,235,300	+58,600
+35,000	5,230,300	+53,600
+30,000	5,225,300	+48,600
+25,000	5,220,300	+43,600
+20,000	5,215,300	+38,600
+15,000	5,210,300	+33,600
+10,000	5,205,300	+28,600
+5,000	5,200,300	+23,600
± 0	5,195,300	+18,600
-5,000	5,190,300	+13,600
-10,000	5,185,300	+8,600
-15,000	5,180,300	+3,600
-20,000	5,175,300	-1,400
-25,000	5,170,300	-6,400
-30,000	5,165,300	-11,400
-35,000	5,160,300	-16,400
-40,000	5,155,300	-21,400
-45,000	5,150,300	-26,400

## <2月7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(1Y-3Y)	25/ 2/10	3,000億	応札 9,516億	落札 3,002億	最低 +0.021%	平均 +0.024%	按分 11.0%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	25/ 2/10	3,000億	応札 12,248億	落札 3,005億	最低 +0.032%	平均 +0.032%	按分 68.9%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	25/ 2/10	3,250億	応札 6,464億	落札 3,254億	最低 +0.021%	平均 +0.023%	按分 33.8%
(11:50) 国債補充供給	25/ 2/ 7-25/ 2/10		応札 6,759億	落札 6,759億	全取 +0.150%	平均 +0.150%	
(13:50) 国債補充供給	25/ 2/ 7-25/ 2/10		応札 0億	落札 0億			

## <2月7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)	貸出支援基金の運用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	9,010	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
2/ 5~ 2/19 8,007.	1/31(5-10Y) 3,255.	28,007	836,939
	1/31(25Y-) 753.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17 64,498.
	1/31(物価) 500.	3/ 4~ 3/ 4 2,097.	6/18~ 6/18 26,498.
	2/ 4(-1Y) 1,501.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/19~ 6/18 67,646.
	2/ 4(1-3Y) 3,000.	6/ 3~ 6/ 3 5,318.	9/15~ 9/12 27,659.
	2/ 4(3-5Y) 3,006.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/13~ 9/12 121,454.
	2/ 4(10-25Y) 1,503.	9/ 5~ 9/ 5 1,661.	12/15~12/15 20,129.
	(2/10(1-3Y) 3,002.)	12/ 1~12/ 1 2,464.	12/13~12/15 33,838.
	(2/10(3-5Y) 3,005.)	12/ 4~12/ 4 842.	3/16~ 3/16 38,879.
	(2/10(5-10Y) 3,254.)		
		※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
		9,918百万ドル	3百万ドル
		3/ 4~ 3/ 4 2,097.	2/ 6~ 2/14 3.
		6/ 3~ 6/ 3 5,318.	
		9/ 5~ 9/ 5 1,661.	
		12/ 4~12/ 4 842.	
		国債買現先オペ	0
		0	0
		国債売現先(米ドルオペ用担保)	0
		0	0
		国債売現先オペ	0
		0	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
		0	
		国債補充供給	6,759
		2/ 7~ 2/10 6,759.	
		2/ 7~ 2/10 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
		0	
		社債買入額(月初末)	0
		0	
		国債買現先	0
		被災地金融機関支援	863
		気候変動対応支援	142,065
		成長基盤支援	24,018
		貸出増加支援	771,475
		供給オペ合計	1,016,463
		貸出(推定)	0
		国債補充供給	6,759
		供給額合計	1,016,463
		吸収額合計	6,759
		差し引き	1,009,704

※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7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 +0.400	1M +0.523000	3M 買気配 +0.350
1W 売気配 +0.400	2M -----	6M 買気配 +0.450
2W 売気配 +0.400	3M +0.609000	1Y 買気配 +0.600
1M 売気配 +0.400		

## <2月6日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	124,725	+925
有担保	38,637	-934
無担保	86,088	+1,859

## <2月7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	0.450	0.525	0.477	-0.002			0.430	± 0	0.381	-0.101
トムネ				-----				-----	0.445	+0.035
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.478	0.650	0.501	-0.024				-----	0.426	± 0
2週間物			0.540	-0.003				-----	0.429	± 0
3週間物				-----				-----	0.431	+0.001
1ヶ月物				-----				-----	0.429	-0.004
3ヶ月物			0.575	-----				-----	0.448	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.480	± 0
1年物				-----				-----	0.551	± 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