

東京短資デイリーレポート

2026/1/9

<1月8日のマナリーベース>

5,922,500

<1月9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	4,677,300
前日の日銀当座預金残高-①	4,681,500
日銀当座預金残高増減前日比	-4,200

<1月9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		+2,700
財政等要因		-6,500
資金過不足		-3,800
金融調節		
国債補完供給	+2,100	-5,800
金融調節合計		-3,700
当座預金増減-②		-7,500

<1月9日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,674,000
準備預金残高	4,279,300
積み終了先	4,279,300
超過準備	4,279,300
非準備先残高	394,700

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,128,200
今積み期間所要準備額 (平均)	133,200
残り要積立額 (積数)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率(%)	100.0
日数進捗率(%)	90.3
進捗率乖離幅	+9.7

<1月13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		+2,200
財政等要因		-9,000
資金過不足		-6,800
金融調節確定分		
国債補完供給	+5,800	新規
金融調節合計		+5,800
当座預金増減		-1,000

<1月13日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残467兆3,000億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。

<1月13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	4,718,000	+44,000
+40,000	4,713,000	+39,000
+35,000	4,708,000	+34,000
+30,000	4,703,000	+29,000
+25,000	4,698,000	+24,000
+20,000	4,693,000	+19,000
+15,000	4,688,000	+14,000
+10,000	4,683,000	+9,000
+5,000	4,678,000	+4,000
± 0	4,673,000	-1,000
-5,000	4,668,000	-6,000
-10,000	4,663,000	-11,000
-15,000	4,658,000	-16,000
-20,000	4,653,000	-21,000
-25,000	4,648,000	-26,000
-30,000	4,643,000	-31,000
-35,000	4,638,000	-36,000
-40,000	4,633,000	-41,000
-45,000	4,628,000	-46,000

<1月9日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	26/ 1/ 9-26/ 1/13	応札 6,149億 落札 6,149億 全取 +0.450% 平均 +0.450%
(13:50) 国債補完供給	26/ 1/ 9-26/ 1/13	応札 41億 落札 41億 全取 +0.450% 平均 +0.450%

<1月9日 各オペ残高と内訳>

共通担保(全店)固定金利		国債買入額(月初来)		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	
8,005	7,111	11,082	580,669	171,298	130		
1/ 7~ 1/21 8,005.	1/ 8(-1Y) 1,003.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/16~ 3/16 38,879.	2/16~ 2/16 0.			
	1/ 8(1-3Y) 2,703.	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.	2/17~ 2/16 0.			
	1/ 8(3-5Y) 2,454.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 70,188.	5/12~ 5/12 0.			
	1/ 8(10-25Y) 951.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/20~ 6/19 46,265.	8/18~ 8/18 130.			
			9/14~ 9/14 30,590.	11/17~11/17 0.			
			9/12~ 9/14 10,693.				
			12/14~12/14 36,712.				
			12/15~12/14 5,876.				
共通担保(全店)金利入札		成長基盤強化支援米ドル特別		貸出増加支援資金供給		被災地金融機関支援資金供給	
70,035		3,214百万ドル	0百万ドル	171,298	130		
1/24~ 1/24 10,003.		3/ 4~ 3/ 4 830.	1/ 8~ 1/15 0.	1/30~ 1/30 69,704.			
2/ 1~ 2/ 1 10,004.		6/ 3~ 6/ 3 2,384.		7/18~ 7/21 101,594.			
2/15~ 2/15 10,004.							
3/ 1~ 3/ 1 10,010.							
9/15~ 9/15 10,005.							
10/10~10/10 10,006.							
10/25~10/25 10,003.							
国債買入先オペ		国債売先オペ		国債買入先オペ		国債売先オペ	
		0	0	0	0		
ETF買入額		CP買入額(月初来)		社債買入額(月初来)		国債買入額(固定利回)(月初来)	
356,921		0	0	0	0	0	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.							
国債補完供給		C P買入額(月初来)		社債買入額(月初来)		国債買入額(固定利回)(月初来)	
6,190		0	0	0	0	0	0
1/ 9~ 1/13 6,149.							
1/ 9~ 1/13 41.							
ETF買入額		C P買入額(月初来)		社債買入額(月初来)		国債買入額(固定利回)(月初来)	
356,921		0	0	0	0	0	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.							

※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9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売気配 +0.81900Q03M	買気配 +0.700			
1W 売気配 +0.650	2M売気配 +0.93000Q06M	買気配 +0.850			
2W 売気配 +0.650	3M	1Y 買気配 +0.950			
1M 売気配 +0.650					

<1月8日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	110,944	+1,555
有担保	28,357	+157
無担保	82,587	+1,398

<1月9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	-0.002			0.680	± 0	0.743	+0.004
トムネ				-----				-----	0.750	+0.008
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.720	0.734	0.725	-0.041				-----	0.739	+0.001
2週間物	0.723	0.785	0.732	+0.004				-----	0.738	± 0
3週間物				-----				-----	0.738	± 0
1ヶ月物			0.790	-0.040				-----	0.739	+0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.745	± 0
6ヶ月物			1.060	-----				-----	0.781	+0.002
1年物				-----				-----	0.885	+0.001

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