

東京短資デイリーレポート

2026/1/27

<1月26日のマナリーベース>

5,864,100

<1月27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	4,640,000
前日の日銀当座預金残高-①	4,641,500
日銀当座預金残高増減前日比	-1,500

<1月27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	+800	
財政等要因	-6,700	
資金過不足	-5,900	
金融調節		
CP等買入	期落	新規
	-100	
社債等買入	-200	
国債補完供給	+4,300	-3,200
金融調節合計		+800
当座預金増減-②		-5,100

<1月27日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,636,400
準備預金残高	4,267,700
積み終了先	4,265,800
超過準備	4,265,800
非準備先残高	368,700

<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)	8,900
残り要積立額 (平均)	500
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	38.7
進捗率乖離幅	+61.0

<1月28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	+1,100	
資金過不足	+2,000	
金融調節確定分		
国債補完供給	期落	新規
	+3,200	
金融調節合計		+3,200
当座預金増減		+5,200

<1月28日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残464兆1,600億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。

<1月28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	4,686,600	+50,200
+40,000	4,681,600	+45,200
+35,000	4,676,600	+40,200
+30,000	4,671,600	+35,200
+25,000	4,666,600	+30,200
+20,000	4,661,600	+25,200
+15,000	4,656,600	+20,200
+10,000	4,651,600	+15,200
+5,000	4,646,600	+10,200
± 0	4,641,600	+5,200
-5,000	4,636,600	+200
-10,000	4,631,600	-4,800
-15,000	4,626,600	-9,800
-20,000	4,621,600	-14,800
-25,000	4,616,600	-19,800
-30,000	4,611,600	-24,800
-35,000	4,606,600	-29,800
-40,000	4,601,600	-34,800
-45,000	4,596,600	-39,800

<1月27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/ 1/29-26/ 2/ 5	応札 1m1 落札 1m1	貸付 3.880%
(11:50) 国債補完供給	26/ 1/27-26/ 1/28	応札 3,405億 落札 3,405億 全取 +0.550% 平均 +0.550%	
(13:50) 国債補完供給	26/ 1/27-26/ 1/28	応札 0億 落札 0億	

<1月27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(月初来)	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
8,005	22,632	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
1/21~ 2/ 4 8,005.	1/22(1-3Y) 2,703.	11,082	580,669
	1/22(3-5Y) 2,455.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/16~ 3/16 38,879.
	1/22(5-10Y) 2,602.	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.
	1/22(25Y-) 750.	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	6百万ドル
		3/ 4~ 3/ 4 830.	1/22~ 1/29 6.
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	(1/29~ 2/ 5 1.)
			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.
		国債買現先オペ	
		0	
		国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			8
			1/21~ 1/30 8.
		国債売現先オペ	
		0	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		国債買入額(固定利回)(月初来)	
		0	
		CP買入額(月初来)	
		0	
		社債買入額(月初来)	
		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	
		共通担保(全店)固定金利	
		70,035	
		1/24~ 1/24 10,003.	
		2/ 1~ 2/ 1 10,004.	
		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.	
		国債補完供給	
		3,405	
		1/27~ 1/28 3,405.	
		1/27~ 1/28 0.	
		国債買現先オペ	
		0	
		国債売現先(米ドルオペ用担保)	
		8	
		1/21~ 1/30 8.	
		国債売現先オペ	
		0	
		※直近約1週間の実施分を記載	
		国債買入額(固定利回)(月初来)	
		0	
		CP買入額(月初来)	
		0	
		社債買入額(月初来)	
		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	
		共通担保(全)固定	8,005
		CP等買入(推定)	100
		共通担保(全)金入	70,035
		社債等買入(推定)	26,000
		国債買現先	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
		国債売現先	0
		供給オペ合計	795,210
		国債補完供給	3,405
		貸出(推定)	0
		国売現(米ドル担保)	8
		供給額合計	795,210
		吸収額合計	3,413
		差し引き	791,797

※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27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 +0.903000	3M 買気配 +0.850
1W	売気配 +0.650	2M +0.950000	6M 買気配 +0.850
2W	売気配 +0.650	3M +0.990000	1Y 買気配 +1.050
1M	売気配 +0.650		

<1月26日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	130,049	+1,639
有担保	28,392	-100
無担保	101,657	+1,739

<1月27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	0.800	0.736	+0.008			0.680	± 0	0.744	± 0
トムネ				-----				-----	0.750	± 0
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.710	0.780	0.731	-0.034				-----	0.746	+0.003
2週間物	0.710	0.728	0.724	+0.009				-----	0.745	+0.002
3週間物				-----				-----	0.745	+0.002
1ヶ月物	0.805	0.810	0.807	+0.013				-----	0.747	+0.001
3ヶ月物			0.865	-----				-----	0.758	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.820	+0.004
1年物				-----				-----	0.932	+0.006

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