

# 東京短資デイリーレポート

2026/2/4

## <2月3日のマナリーベース>

5,855,900
-----------

## <2月4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	4,549,600
前日の日銀当座預金残高-①	4,637,700
日銀当座預金残高増減前日比	-88,100

## <2月4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		+50
財政等要因		-93,600
資金過不足		-93,100
金融調節		
共通担保(全店)	期落	新規
	-8,000	+8,000
社債等買入		-200
国債補完供給		+2,900
金融調節合計		+400
当座預金増減-②		-92,700

## <2月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,545,000
準備預金残高	4,190,200
積み終了先	4,190,100
超過準備	4,190,000
非準備先残高	354,800

## <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(%)	64.5
進捗率乖離幅	+35.4

## <2月5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		0
財政等要因		+2,600
資金過不足		+2,600
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
		+6,900
国債補完供給		+2,300
金融調節合計		+9,200
当座預金増減		+11,800

## <2月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残455兆6,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。
---

## <2月5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	4,601,800	+56,800
+40,000	4,596,800	+51,800
+35,000	4,591,800	+46,800
+30,000	4,586,800	+41,800
+25,000	4,581,800	+36,800
+20,000	4,576,800	+31,800
+15,000	4,571,800	+26,800
+10,000	4,566,800	+21,800
+5,000	4,561,800	+16,800
±0	4,556,800	+11,800
-5,000	4,551,800	+6,800
-10,000	4,546,800	+1,800
-15,000	4,541,800	-3,200
-20,000	4,536,800	-8,200
-25,000	4,531,800	-13,200
-30,000	4,526,800	-18,200
-35,000	4,521,800	-23,200
-40,000	4,516,800	-28,200
-45,000	4,511,800	-33,200

## <2月4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)	26/ 2/ 5	1,000億 応札 3,458億 落札 1,001億 最低 +0.016% 平均 +0.020% 按分 53.9%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	26/ 2/ 5	2,700億 応札 5,886億 落札 2,703億 最低 -0.003% 平均 -0.002% 按分 89.0%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	26/ 2/ 5	2,450億 応札 6,717億 落札 2,454億 最低 +0.001% 平均 +0.002% 按分 75.1%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	26/ 2/ 5	950億 応札 3,840億 落札 956億 最低 +0.003% 平均 +0.005% 按分 43.8%
(11:50) 国債補完供給	26/ 2/ 4-26/ 2/ 5	応札 2,518億 落札 2,518億 全取 +0.450% 平均 +0.450%
(13:50) 国債補完供給	26/ 2/ 4-26/ 2/ 5	応札 2億 落札 2億 全取 +0.450% 平均 +0.450%

## <2月4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)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
8,007	0	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. 1/30(5-10Y) 2,607. 1/30(10-25Y) 954. 1/30(物国) 400. (2/ 5(-1Y) 1,001.) (2/ 5(1-3Y) 2,703.) (2/ 5(3-5Y) 2,454.) (2/ 5(10-25Y) 956.)	11,082 3/ 2~ 3/ 2 7,922. 3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 3,160. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	580,669 3/16~ 3/16 38,879. 3/17~ 3/16 18,695. 6/18~ 6/18 70,188. 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.	2/16~ 2/16 0. 2/17~ 2/16 0. 5/12~ 5/12 0. 8/18~ 8/18 130. 11/17~11/17 0.
共通担保(全店)金利入札	70,035	※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	被災地金融機関支援資金供給
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.	※直近約1週間の実施分を記載	成長基盤強化支援米ドル特則	米ドル資金供給オペ	気候変動対応支援資金供給
国債補完供給	2,520	3,214百万ドル	1百万ドル	211,146
2/ 4~ 2/ 5 2,518. 2/ 4~ 2/ 5 2.	国債買入額(固定利回)(月初末)	3/ 4~ 3/ 4 830. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	1/29~ 2/ 5 1. (2/ 5~ 2/13 3.)	7/18~ 7/21 101,594. 1/30~ 2/ 1 109,552.
ETF買入額	356,921	国債買入先オペ	0	国債売入先オペ(米ドルオペ用担保)
約定 23/10/ 4 701. ETF買入額(企業支援)	14,628	0	2	2/ 4~ 2/16 2.
約定 21/ 3/31 12.	J-REIT買入額	0	0	国庫短期証券買入額(月初末)
6,823	0	CP買入額(月初末)	0	0
約定 22/ 6/14 12.	※直近約1週間の実施分を記載	0	0	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4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 +0.800000	3M 買気配 +0.800
1W	売気配 +0.650	2M +0.900000	6M 買気配 +0.900
2W	売気配 +0.650	3M -----	1Y 買気配 +1.050
1M	売気配 +0.650		

## <2月3日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	133,868	-251
有担保	24,608	-859
無担保	109,260	+608

## <2月4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	-0.003			0.680	±0	0.747	+0.005
トムネ				-----				-----	0.746	-0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.733	0.782	0.769	-0.011				-----	0.746	±0
2週間物	0.710	0.870	0.760	+0.033				-----	0.746	±0
3週間物				-----				-----	0.746	±0
1ヶ月物	0.780	0.850	0.809	+0.023				-----	0.747	±0
3ヶ月物				-----				-----	0.770	+0.004
6ヶ月物				-----				-----	0.830	+0.002
1年物				-----				-----	0.949	+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