

# 東京短資デイリーレポート

2026/2/26

## <2月25日のマネタリーベース>

5,821,500
-----------

## <2月26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	4,607,600
前日の日銀当座預金残高-①	4,605,900
日銀当座預金残高増減前日比	+1,700

## <2月26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		-300
財政等要因		-4,400
資金過不足		-4,700
金融調節		
	期落	新規
社債等買入	-100	
国債補完供給	+3,600	-3,600
金融調節合計		-100
当座預金増減-②		-4,800

## <2月26日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,601,100
準備預金残高	4,250,000
積み終了先	4,249,200
超過準備	4,249,200
非準備先残高	351,100

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,731,900
今積み期間所要準備額(平均)	133,300
残り要積立額(積数)	6,000
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	39.3
進捗率乖離幅	+60.5

## <2月27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		+300
財政等要因		+5,500
資金過不足		+5,800
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+6,100
社債等買入	-800	
国債補完供給	+3,600	
金融調節合計		+8,900
当座預金増減		+14,700

## <2月27日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残461兆5,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。
---

## <2月27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	4,660,800	+59,700
+40,000	4,655,800	+54,700
+35,000	4,650,800	+49,700
+30,000	4,645,800	+44,700
+25,000	4,640,800	+39,700
+20,000	4,635,800	+34,700
+15,000	4,630,800	+29,700
+10,000	4,625,800	+24,700
+5,000	4,620,800	+19,700
± 0	4,615,800	+14,700
-5,000	4,610,800	+9,700
-10,000	4,605,800	+4,700
-15,000	4,600,800	-300
-20,000	4,595,800	-5,300
-25,000	4,590,800	-10,300
-30,000	4,585,800	-15,300
-35,000	4,580,800	-20,300
-40,000	4,575,800	-25,300
-45,000	4,570,800	-30,300

## <2月26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(3Y-5Y)	26/ 2/27	2,450億 応札 6,831億 落札 2,453億	最低 +0.034% 平均 +0.036% 按分 86.1%
(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	26/ 2/27	2,600億 応札 8,082億 落札 2,601億	最低 +0.029% 平均 +0.029% 按分 90.9%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	26/ 2/27	950億 応札 3,100億 落札 952億	最低 +0.027% 平均 +0.031% 按分 37.0%
(10:10) 国債買入(物国)	26/ 2/27	400億 応札 1,494億 落札 401億	按分-0.377円 平均-0.377円 按分 77.1%
(11:50) 国債補完供給	26/ 2/26-26/ 2/27	応札 3,860億 落札 3,860億	全取 +0.550% 平均 +0.550%
(13:50) 国債補完供給	26/ 2/26-26/ 2/27	応札 20億 落札 20億	全取 +0.550% 平均 +0.550%

## <2月26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
8,005	22,629	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
2/18~ 3/ 4 8,005.	2/19(1-3Y) 2,701.	11,082	580,669
	2/19(5-10Y) 2,602.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/16~ 3/16 38,879.
	2/19(25Y-) 750.	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.
	(2/27(3-5Y) 2,453.)	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 70,188.
	(2/27(5-10Y) 2,601.)	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/20~ 6/19 46,265.
	(2/27(10-25Y) 952.)		9/14~ 9/14 30,590.
	(2/27(物国) 401.)		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則	米ドル資金供給オペ
		3,214百万ドル	0百万ドル
		3/ 4~ 3/ 4 830.	2/26~ 3/ 5 0.
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	
		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
		CP買入額(月初末)	0
		0	0
		社債買入額(月初末)	0
		0	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	
		国債補完供給	3,880
		2/26~ 2/27 3,860.	
		2/26~ 2/27 20.	
		国債買入額(月初末)	0
		0	0
		国債売現先(米ドル担保)	0
		0	0
		供給オペ合計	835,058
		貸出(推定)	0
		供給額合計	835,058
		吸収額合計	3,880
		差し引き	831,178

※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26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 +0.910000	3M 買気配 +0.950
1W	売気配 +0.650	2M -----	6M 買気配 +0.950
2W	売気配 +0.650	3M -----	1Y 買気配 +1.050
1M	売気配 +0.650		

## <2月25日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	129,152	+166
有担保	25,624	-748
無担保	103,528	+914

## <2月26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	0.728	-0.001			0.680	± 0	0.748	+0.001
トムネ				-----				-----	0.747	-0.003
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.780	0.860	0.796	+0.046				-----	0.747	± 0
2週間物	0.731	0.900	0.776	+0.048				-----	0.747	± 0
3週間物	0.810	0.950	0.866	-----				-----	0.747	± 0
1ヶ月物	0.820	0.850	0.828	-0.118				-----	0.748	± 0
3ヶ月物	1.040	1.100	1.070	+0.070				-----	0.803	± 0
6ヶ月物				-----				-----	0.874	± 0
1年物				-----				-----	0.989	± 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