

東京短資デイリーレポート

2026/3/4

<3月3日のマナリーベース>

5,758,600

<3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	4,476,800
前日の日銀当座預金残高-①	4,543,500
日銀当座預金残高増減前日比	-66,700

<3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		-100
財政等要因		-70,200
資金過不足		-70,300
金融調節		
共通担保(全店)	期落	新規
	-8,000	+8,000
社債等買入		-100
国債補完供給		+3,600
金融調節合計		-500
当座預金増減-②		-70,800

<3月4日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,472,700
準備預金残高	4,121,300
積み終了先	4,120,700
超過準備	4,120,700
非準備先残高	351,400

<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)	1,200
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	60.7
進捗率乖離幅	+39.2

<3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		+200
財政等要因		+4,300
資金過不足		+4,500
金融調節確定分		
国債買入	期落	新規
		+6,700
社債等買入		-100
国債補完供給		+3,600
金融調節合計		+10,200
当座預金増減		+14,700

<3月5日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残448兆7,400億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。

<3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	4,532,400	+59,700
+40,000	4,527,400	+54,700
+35,000	4,522,400	+49,700
+30,000	4,517,400	+44,700
+25,000	4,512,400	+39,700
+20,000	4,507,400	+34,700
+15,000	4,502,400	+29,700
+10,000	4,497,400	+24,700
+5,000	4,492,400	+19,700
± 0	4,487,400	+14,700
-5,000	4,482,400	+9,700
-10,000	4,477,400	+4,700
-15,000	4,472,400	-300
-20,000	4,467,400	-5,300
-25,000	4,462,400	-10,300
-30,000	4,457,400	-15,300
-35,000	4,452,400	-20,300
-40,000	4,447,400	-25,300
-45,000	4,442,400	-30,300

<3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/ 3/ 5	1,000億	応札 4,883億	落札 1,001億	最低 -0.004%	平均 -0.001%	按分 26.9%
(10:10) 国債買入(1Y-3Y)	26/ 3/ 5	2,700億	応札 8,523億	落札 2,702億	最低 -0.017%	平均 -0.016%	按分 81.6%
(10:10) 国債買入(3Y-5Y)	26/ 3/ 5	2,450億	応札 7,137億	落札 2,454億	最低 -0.022%	平均 -0.021%	按分 73.2%
(10:10) 国債買入(10Y-25Y)	26/ 3/ 5	950億	応札 2,040億	落札 951億	最低 +0.008%	平均 +0.012%	按分 39.8%
(11:50) 国債補完供給	26/ 3/ 4-26/ 3/ 5		応札 4,115億	落札 4,115億	全取 +0.550%	平均 +0.550%	
(13:50) 国債補完供給	26/ 3/ 4-26/ 3/ 5		応札 31億	落札 31億	全取 +0.550%	平均 +0.518%	

<3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
8,003	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給
3/ 4- 3/18 8,003.	2/27(3-5Y) 2,453.	3,160	580,669
	2/27(5-10Y) 2,601.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	3/16~ 3/16 38,879.
	2/27(10-25Y) 952.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	3/17~ 3/16 18,695.
	2/27(物国) 401.		6/18~ 6/18 70,188.
	(3/ 5(-1Y) 1,001.)		6/20~ 6/19 46,265.
	(3/ 5(1-3Y) 2,702.)		9/14~ 9/14 30,590.
	(3/ 5(3-5Y) 2,454.)		9/12~ 9/12 10,693.
	(3/ 5(10-25Y) 951.)		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
			成長基盤強化支援ドル特別
			2,384百万ドル
			貸出増加支援資金供給
			0百万ドル
			6/ 3~ 6/ 3 2,384.
			2/26~ 3/ 5 0.
			(3/ 5~ 3/12 1.)
			気候変動対応支援資金供給
			211,146
			7/18~ 7/21 101,594.
			1/30~ 2/ 1 109,552.
			国債買入先オペ
			0
			国債売入先(米ドルオペ用担保)
			2
			3/ 4~ 3/13 2.
			国債売入先オペ
			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
			国債補完供給
			4,146
			3/ 4~ 3/ 5 4,115.
			3/ 4~ 3/ 5 31.
			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
			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。
			<3月4日 日銀信用概算(除く買切)>
			共通担保(全)固定 8,003 CP等買入(推定) 0
			共通担保(全)金入 70,035 社債等買入(推定) 24,000
			国債買入先 0
			被災地金融機関支援 130
			気候変動対応支援 211,146
			成長基盤支援 2,492 手形売切 0
			貸出増加支援 535,328 国債売入先 0
			供給オペ合計 827,134 国債補完供給 4,146
			貸出(推定) 0 国債売入先(米ドル担保) 2
			供給額合計 827,134 吸収額合計 4,148
			差し引き 822,986

<3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 +0.887000	3M 買気配 +0.800
1W	売気配 +0.650	2M -----	6M 買気配 +0.950
2W	売気配 +0.650	3M +1.250000	1Y 買気配 +1.050
1M	売気配 +0.650		

<3月3日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	125,667	+920
有担保	25,148	-144
無担保	100,519	+1,064

<3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	0.730	+0.003			0.680	± 0	0.748	± 0
トムネ				-----				-----	0.750	± 0
スポネ				-----				-----		
1週間物			0.810	+0.087				-----	0.747	± 0
2週間物	0.710	0.800	0.743	+0.010				-----	0.747	± 0
3週間物			0.800	-----				-----	0.747	± 0
1ヶ月物			0.950	-----				-----	0.748	± 0
3ヶ月物			1.170	+0.070				-----	0.807	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.880	± 0
1年物				-----				-----	0.990	± 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ようをお願いいたします。
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