

東京短資デイリーレポート

2025/2/5

<2月4日のマナリーベース>

6,445,500

<2月5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	5,175,400
前日の日銀当座預金残高-①	5,197,800
日銀当座預金残高増減前日比	-22,400

<2月5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	+900	
財政等要因	-27,700	
資金過不足	-26,800	
金融調節		
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+4,900	-5,000
金融調節合計		-100
当座預金増減-②		-26,900

<2月5日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,170,900
準備預金残高	4,669,900
積み終了先	4,669,200
超過準備	4,669,200
非準備先残高	501,000

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	4,074,100
今積み期間所要準備額(平均)	131,400
残り要積立額(積数)	3,700
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	67.7
進捗率乖離幅	+32.2

<2月6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	+1,700
資金過不足	+2,600
金融調節確定分	
国債補完供給	+5,000
金融調節合計	+5,000
当座預金増減	+7,600

<2月6日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残517兆8,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.470%~+0.477% での合いが中心か。

<2月6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	5,223,500	+52,600
+40,000	5,218,500	+47,600
+35,000	5,213,500	+42,600
+30,000	5,208,500	+37,600
+25,000	5,203,500	+32,600
+20,000	5,198,500	+27,600
+15,000	5,193,500	+22,600
+10,000	5,188,500	+17,600
+5,000	5,183,500	+12,600
± 0	5,178,500	+7,600
-5,000	5,173,500	+2,600
-10,000	5,168,500	-2,400
-15,000	5,163,500	-7,400
-20,000	5,158,500	-12,400
-25,000	5,153,500	-17,400
-30,000	5,148,500	-22,400
-35,000	5,143,500	-27,400
-40,000	5,138,500	-32,400
-45,000	5,133,500	-37,400

<2月5日 日銀オペ入札結果>

(11:50) 国債補完供給	25/ 2/ 5-25/ 2/ 6	応札 5,199億 落札 5,199億 全取 +0.150% 平均 +0.150%
(13:50) 国債補完供給	25/ 2/ 5-25/ 2/ 6	応札 10億 落札 10億 全取 +0.150% 平均 +0.150%

<2月5日 各オペ残高と内訳>

共通担保(全店)固定金利		国債買入額(月初末)		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	
8,007	9,010	28,007	836,939	863		863	
2/ 5- 2/19	8,007.	1/29(1-3Y) 3,007.	3/ 3~ 3/ 3 6,793.	3/17~ 3/17	64,498.	2/17~ 2/17	346.
		1/29(3-5Y) 3,010.	3/ 4~ 3/ 4 2,097.	6/18~ 6/18	26,498.	5/17~ 5/12	0.
		1/29(10-25Y) 1,502.	6/ 2~ 6/ 2 2,644.	6/19~ 6/18	67,646.	5/12~ 5/12	181.
		1/31(5-10Y) 3,255.	6/ 3~ 6/ 3 5,318.	9/15~ 9/12	27,659.	8/19~ 8/18	279.
		1/31(25Y-) 753.	9/ 1~ 9/ 1 5,024.	9/13~ 9/12	121,454.	8/18~ 8/18	0.
		1/31(物国) 500.	9/ 5~ 9/ 5 1,661.	12/15~12/15	20,129.	11/18~11/17	57.
		2/ 4(-1Y) 1,501.	12/ 1~12/ 1 2,464.	12/13~12/15	33,838.	11/17~11/17	0.
		2/ 4(1-3Y) 3,000.	12/ 4~12/ 4 842.	3/16~ 3/16	38,879.	2/16~ 2/16	0.
		2/ 4(3-5Y) 3,006.					
		2/ 4(10-25Y) 1,503.					
共通担保(全店)金利入札		成長基盤強化支援米ドル特別		米ドル資金供給オペ		被災地金融機関支援資金供給	
70,035		9,918百万ドル		2百万ドル		142,065	
1/24~ 1/24	10,003.	3/ 4~ 3/ 4	2,097.	1/30~ 2/ 6	2.	気候変動対応支援資金供給	
2/ 1~ 2/ 1	10,004.	6/ 3~ 6/ 3	5,318.	(2/ 6~ 2/14	3.)	7/19~ 7/18 72,361.	
2/15~ 2/15	10,004.	9/ 5~ 9/ 5	1,661.			1/30~ 1/30 69,704.	
3/ 1~ 3/ 1	10,010.	12/ 4~12/ 4	842.				
9/15~ 9/15	10,005.						
10/10~10/10	10,006.						
10/25~10/25	10,003.						
国債買入額(固定利回)(月初末)		国債買入額(月初末)		国債売先オペ		国債売先オペ	
0		0		0		0	
国債補完供給		C P買入額(月初末)		社債買入額(月初末)		国債売先オペ	
5,209		0		0		0	
2/ 5- 2/ 6	5,199.						
2/ 5- 2/ 6	10.						
ETF買入額		ETF買入額(企業支援)		ETF買入額(企業支援)		ETF買入額(企業支援)	
356,921		14,628		14,628		14,628	
約定 23/10/ 4 701.		約定 21/ 3/31 12.		約定 21/ 3/31 12.		約定 21/ 3/31 12.	
J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額		J-REIT買入額	
6,823		6,823		6,823		6,823	
約定 22/ 6/14 12.		約定 22/ 6/14 12.		約定 22/ 6/14 12.		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。

<2月5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	1M	+0.565000	3M	買気配 +0.450
1W	売気配 +0.400	2M	-----	6M	買気配 +0.450
2W	売気配 +0.400	3M	-----	1Y	買気配 +0.450
1M	売気配 +0.400				

<2月4日のコール市場残高(単位:億円)>

残高		増減	
市場合計	122,210	+1,341	
有担保	39,420	-308	
無担保	82,790	+1,649	

<2月5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	0.450	0.525	0.479	+0.002			0.430	± 0	0.460	+0.006
トムネ				-----				-----	0.449	+0.001
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.480	0.550	0.486	-0.047				-----	0.434	-0.002
2週間物			0.550	+0.005				-----	0.435	-0.002
3週間物				-----				-----	0.436	-0.001
1ヶ月物			0.550	-----				-----	0.434	-0.004
3ヶ月物	0.600	0.650	0.618	+0.038				-----	0.447	+0.002
6ヶ月物				-----				-----	0.479	+0.002
1年物				-----				-----	0.551	± 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