

# 東京短資デイリーレポート

2026/2/20

## <2月19日のマネタリーベース>

5,813,800
-----------

## <2月20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	4,607,500
前日の日銀当座預金残高-①	4,598,600
日銀当座預金残高増減前日比	+8,900

## <2月20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		-600
財政等要因		+6,000
資金過不足		+5,400
金融調節		
国債補完供給	期落	新規
	+1,900	-3,800
金融調節合計		-1,900
当座預金増減-②		+3,500

## <2月20日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	4,602,100
準備預金残高	4,250,900
積み終了先	4,249,800
超過準備	4,245,200
非準備先残高	351,200

## <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)	8,600
残り要積立額(平均)	400
準備進捗率(%)	99.7
日数進捗率(%)	28.6
進捗率乖離幅	+71.1

## <2月24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		-7,100
資金過不足		-7,400
金融調節確定分		
国債補完供給	期落	新規
	+3,800	
金融調節合計		+3,800
当座預金増減		-3,600

## <2月24日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残459兆8,500億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。
-----------------------------------------------------------------------------

## <2月24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	4,643,500	+41,400
+40,000	4,638,500	+36,400
+35,000	4,633,500	+31,400
+30,000	4,628,500	+26,400
+25,000	4,623,500	+21,400
+20,000	4,618,500	+16,400
+15,000	4,613,500	+11,400
+10,000	4,608,500	+6,400
+5,000	4,603,500	+1,400
±0	4,598,500	-3,600
-5,000	4,593,500	-8,600
-10,000	4,588,500	-13,600
-15,000	4,583,500	-18,600
-20,000	4,578,500	-23,600
-25,000	4,573,500	-28,600
-30,000	4,568,500	-33,600
-35,000	4,563,500	-38,600
-40,000	4,558,500	-43,600
-45,000	4,553,500	-48,600

## <2月20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。

(11:50) 国債補完供給	26/ 2/20-26/ 2/24	応札 4,022億 落札 4,022億 全取 +0.550% 平均 +0.550%
(13:50) 国債補完供給	26/ 2/20-26/ 2/24	応札 15億 落札 15億 全取 +0.550% 平均 +0.550%

## <2月20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	22,629	成長基盤強化支援資金供給	130
2/18~ 3/ 4 8,005.	2/13(1-3Y) 2,702.	11,082	580,669
	2/13(3-5Y) 2,453.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	3/16~ 3/16 38,879.
	2/13(5-10Y) 2,603.	3/ 4~ 3/ 4 830.	3/17~ 3/16 18,695.
	2/13(10-25Y) 953.	2/13(10-25Y) 953.	6/18~ 6/18 70,188.
	2/13(25Y-) 751.	6/ 3~ 6/ 3 3,160.	6/18~ 6/18 70,188.
	2/19(1-3Y) 2,701.	6/ 3~ 6/ 3 2,384.	6/20~ 6/19 46,265.
	2/19(5-10Y) 2,602.		9/14~ 9/14 30,590.
	2/19(25Y-) 750.		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	4百万ドル
		3/ 4~ 3/ 4 830.	2/19~ 2/26 4.
		6/ 3~ 6/ 3 2,384.	
		国債買入先オペ	0
		0	0
		国債売入先(米ドルオペ用担保)	0
		0	0
		国債売入先オペ	0
		0	0
		※直近約1週間の実施分を記載	※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
		0	0
		CP買入額(月初来)	0
		0	0
		社債買入額(月初来)	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.	

※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20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	+0.923000	3M	買気配 +0.800
1W	売気配 +0.650	2M	+1.050000	6M	買気配 +0.950
2W	売気配 +0.650	3M	+1.160000	1Y	買気配 +1.100
1M	売気配 +0.650				

## <2月19日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	129,290	-224
有担保	25,515	+278
無担保	103,775	-502

## <2月20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	0.775	0.729	+0.001			0.680	±0	0.747	±0
トムネ				-----				-----	0.750	±0
スポネ				-----				-----		
1週間物				-----				-----	0.746	±0
2週間物	0.710	0.720	0.715	-0.050				-----	0.746	±0
3週間物				-----				-----	0.746	±0
1ヶ月物			0.820	-0.002				-----	0.748	+0.001
3ヶ月物				-----				-----	0.794	±0
6ヶ月物				-----				-----	0.872	+0.001
1年物				-----				-----	0.988	+0.002

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