

東京短資デイリーレポート

2026/5/12

<5月11日のマナリーベース>

5,744,800

<5月12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	4,547,000
前日の日銀当座預金残高-①	4,536,300
日銀当座預金残高増減前日比	+10,700

<5月12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		+2,100
財政等要因		-5,500
資金過不足		-3,400
金融調節		
	期落	新規
国債買入		+6,600
国債補完供給	+3,100	-1,900
金融調節合計		+7,800
当座預金増減-②		+4,400

<5月12日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,540,700
準備預金残高	4,203,300
積み終了先	4,203,300
超過準備	4,203,300
非準備先残高	337,400

<参考>

今積み期間所要準備額 (積数)	4,070,400
今積み期間所要準備額 (平均)	135,700
残り要積立額 (積数)	0
残り要積立額 (平均)	0
準備進捗率 (%)	100.0
日数進捗率 (%)	90.0
進捗率乖離幅	+10.0

<5月13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		+1,300
財政等要因		-22,100
資金過不足		-20,800
金融調節確定分		
	期落	新規
共通担保(全店)	-8,000	+8,000
国債補完供給	+1,900	
金融調節合計		+1,900
当座預金増減		-18,900

<5月13日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残452兆1,800億円)で 無担保コール0/Nは+0.721%~+0.727% での合いが中心か。

<5月13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	4,566,800	+26,100
+40,000	4,561,800	+21,100
+35,000	4,556,800	+16,100
+30,000	4,551,800	+11,100
+25,000	4,546,800	+6,100
+20,000	4,541,800	+1,100
+15,000	4,536,800	-3,900
+10,000	4,531,800	-8,900
+5,000	4,526,800	-13,900
± 0	4,521,800	-18,900
-5,000	4,516,800	-23,900
-10,000	4,511,800	-28,900
-15,000	4,506,800	-33,900
-20,000	4,501,800	-38,900
-25,000	4,496,800	-43,900
-30,000	4,491,800	-48,900
-35,000	4,486,800	-53,900
-40,000	4,481,800	-58,900
-45,000	4,476,800	-63,900

<5月12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。

(10:40) 米ドル資金供給	26/ 5/14-26/ 5/21	応札 0m1 落札 0m1	貸付 3.880%
(11:50) 国債補完供給	26/ 5/12-26/ 5/13	応札 2,112億 落札 2,112億 全取 +0.550% 平均 +0.550%	
(13:00) 共通担保(全)国	26/ 5/13-26/ 5/27	8,000億 応札 18,469億 落札 8,009億	貸付 0.750% 按分 43.4%
(13:50) 国債補完供給	26/ 5/12-26/ 5/13	応札 0億 落札 0億	

<5月12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	7,414	成長基盤強化支援資金供給	130
4/28~ 5/13 8,003. (5/13~ 5/27 8,009.)	5/12(-1Y) 1,003. 5/12(1-3Y) 2,555. 5/12(3-5Y) 2,303. 5/12(10-25Y) 802. 5/12(25Y-) 751.	3,160 6/ 3~ 6/ 3 3,160. 6/ 3~ 6/ 3 2,384.	523,095 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. 3/17~ 3/17 78,260. 6/19~ 6/18 59,459.
共通担保(全店)金利入札		※直近約1年分の期落ち分を記載	
70,035		成長基盤強化支援米ドル特別	米ドル資金供給オペ
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.		2,384 5/ 1~ 5/14 1. (5/14~ 5/21 0.)	1百万ドル 気候変動対応支援資金供給
国債補完供給		※直近約1年分の期落ち分を記載	
2,112 5/12~ 5/13 2,112. 5/12~ 5/13 0.		0	211,146 7/18~ 7/21 101,594. 1/30~ 2/ 1 109,552.
ETF買入額		※直近約1週間の実施分を記載	
356,921		0	0
約定 23/10/ 4 701.		国債買入額(固定利回)(月初末)	
ETF買入額(企業支援)		0	
約定 21/ 3/31 12.		C P買入額(月初末)	
J-REIT買入額		0	
6,823		0	
約定 22/ 6/14 12.		社債買入額(月初末)	
		0	
		C P買入額(月初末)	
		0	
		社債買入額(月初末)	
		0	

<5月12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)	19,600
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	2,556	手形売切	0
貸出増加支援	485,331	国債売現先	0
供給オペ合計	777,201	国債補完供給	2,112
貸出(推定)	0	国債売現(米ドル担保)	0
供給額合計	777,201	吸収額合計	2,112
	差し引き		775,089

※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。

<5月12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	+0.838000	3M	買気配 +0.900
1W	売気配 +0.650	2M	+0.950000	6M	買気配 +1.000
2W	売気配 +0.650	3M	-----	1Y	買気配 +1.100
1M	売気配 +0.650				

<5月11日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	110,909	+5,446
有担保	25,425	+803
無担保	85,484	+4,643

<5月12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	0.727	+0.001			0.680	± 0	0.749	+0.004
トムネ				-----				-----	0.754	± 0
スポネ				-----				-----		
1週間物	0.731	0.783	0.764	-0.019				-----	0.750	± 0
2週間物			0.900	-----				-----	0.750	± 0
3週間物				-----				-----	0.750	± 0
1ヶ月物				-----				-----	0.750	± 0
3ヶ月物			1.025	+0.025				-----	0.866	+0.009
6ヶ月物				-----				-----	0.946	+0.003
1年物				-----				-----	1.092	+0.001

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