

Central Daily Market Report

2026年1月30日(金)
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位: 億円	2026年1月30日 需給速報	2026年2月2日 需給予想	2026年2月3日 当社予想			
銀行券	800	800	1,000			
財政	▲ 5,500	▲ 23,900	▲ 20,000			
資金過不足	▲ 4,700	▲ 23,100	▲ 19,000			
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,100					
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			▲ 300			
気候変動対応オペ	109,600	▲ 69,700				
国債補完供給	▲ 2,500	3,900	2,500			
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	42,700	▲ 20,900	▲ 19,000			
当座預金残高	4,681,500	4,660,600	4,641,600			
準備預金残高	4,298,400					
積み終了先	4,297,400			2月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,297,300			積数	2,800	
非準備預金先	383,100			1日平均	200	
積み期間(1/16~2/15日)の所要準備額(積数)					4,133,500	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	54.84%		

●2026年1月30日の市場動向

<無担保コール市場>

本日の無担保コールO/N物は、幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られ、出合いの水準は0.727~0.728%程度で推移した。
ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.75~0.755%程度での出合いとなった。
SCは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

30日は、TDB3M物(第1359回)の入札が実施され、事前予想よりも強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。
この他、6M物、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。
発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

1/30	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値		
O/N	0.700	0.730	0.727	1W	0.731	0.860	0.773	T+0	0.738	
T/N				2W	0.732	0.800	0.775	T+1	0.750	
S/N				3W						
2日				1M	0.740	0.795	0.754	1W	0.746	
3日				2M				2W	0.745	
4日			0.850	3M			0.900	3W	0.746	
5日				4M				1M	0.747	
6日				5M				3M	0.761	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.825	
O/N			0.680	1Y			0.970	1Y	0.941	

JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)			為替(ドル/円)	
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時	
2.244	▲ 0.006	53,322.85	▲ 52.75	153.13-15	153.79-81	
日付		1/23	1/26	1/27	1/28	1/29
日銀当預残	4,636,700	4,641,500	4,636,400	4,638,800	4,638,800	
準備預金残	4,269,800	4,276,100	4,267,900	4,266,100	4,271,400	
マネタリーベース	5,859,900	5,864,100	5,858,200	5,859,700	5,859,600	
無担O/N加重平均	0.727%	0.728%	0.736%	0.727%	0.727%	
コール市場残高	128,410	130,049	137,108	128,178	128,094	
うち無担	99,918	101,657	109,794	100,017	102,315	
うちO/N	41,085	42,219	48,876	38,919	40,097	
うち有担	28,492	28,392	27,314	28,161	25,779	

●入札結果

名称	回数	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1359	-	47,000	2026/2/2	2026/5/7	118,206	36,987.6	99.8050	0.7586%	27.3269%	99.8068	0.7516%	10,012	
2年利付国債	481	1.3%	28,000	2026/2/2	2028/2/1	84,656	21,839	100.080	1.258%	48.3391%	100.090	1.253%	6,154	1.75

●オペ結果

種類	オフター額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率(%)	利回り(%)※1	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2026/1/30	2026/2/2		0.450	2,519	2,519		0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2026/1/30	2026/2/2		0.450	262	262		0.450	0.450	

●2026年2月2日の予定

*決定会合における主な意見(1月22,23日分)	*1月のISM製造業景況指数
--------------------------	----------------

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。
◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。
セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入