

# Central Daily Market Report

2026年2月2日(月)

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2月2日 需給速報	2026年2月3日 需給予想	2026年2月4日 当社予想			
銀行券	900	800	1,000			
財政	▲ 25,300	▲ 22,700	▲ 91,500			
資金過不足	▲ 24,400	▲ 21,900	▲ 90,500			
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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
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						
国債補完供給	▲ 3,300	2,500		3,300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 25,500	▲ 18,600	▲ 98,500			
当座預金残高	4,656,000	4,637,400	4,538,900			
準備預金残高	4,301,600					
積み終了先	4,300,300		2月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,300,300		積数	1,500		
非準備預金先	354,400		1日平均	100		
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	99.96%	日数	58.06%		

## ●2026年2月2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、0.745~0.75%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>

2日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

### <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

2/2	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	0.728	0.727	1W	0.734	0.850	0.768	T+0	0.748	
T/N			0.850	2W	0.728	0.850	0.747	T+1	0.750	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.745	
3日				2M				2W	0.745	
4日				3M				3W	0.745	
5日				4M				1M	0.747	
6日				5M				3M	0.762	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.827	
O/N			0.680	1Y				1Y	0.943	

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	
2.230	▲ 0.014	52,655.18	▲ 667.67	155.19-21	154.88-90	
日付		1/26	1/27	1/28	1/29	1/30
日銀当預残	4,641,500	4,636,400	4,638,800	4,638,800	4,681,500	
準備預金残	4,276,100	4,267,900	4,266,100	4,271,400	4,298,400	
マネタリーベース	5,864,100	5,858,200	5,859,700	5,859,600	5,901,400	
無担O/N加重平均	0.728%	0.736%	0.727%	0.727%	0.727%	
コール市場残高	130,049	137,108	128,178	128,094	125,517	
うち無担	101,657	109,794	100,017	102,315	100,152	
うちO/N	42,219	48,876	38,919	40,097	38,634	
うち有担	28,392	27,314	28,161	25,779	25,365	

## ●入札結果

名称	回号	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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。														

## ●オペ結果

種類	オファー額(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(午前オファー分)		2026/2/2	2026/2/3		0.550	3,563	3,563		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/2/2	2026/2/3		0.550	0	0				

## ●2026年2月3日の予定

*1月のマネタリーベース *財政資金対民間収支前月実績/当月見込	*10年利付国債入札 (26,000億円、2/4発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、2/13借入)
-------------------------------------	--------------------------------	---------------------------------

◆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