

Central Daily Market Report

2026年2月3日(火)

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3日 需給速報 | 2026年2月4日 需給予想 | 2026年2月5日 当社予想 |
|---------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 銀行券 | 800 | 600 | 500 |
| 財政 | ▲ 18,900 | ▲ 91,400 | 0 |
| 資金過不足 | ▲ 18,100 | ▲ 90,800 | 500 |
| 金融調節 | スタート | エンド | スタート |
| 貸出 | | | |
| 全店共通 | | 8,000 | ▲ 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 | | ▲ 200 | |
| 気候変動対応オペ | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 2,900 | 2,700 | 2,900 |
| 米ドル資金供給用担保国債供給 | | | |
| 当預増減 | ▲ 18,300 | ▲ 88,100 | 500 |
| 当座預金残高 | 4,637,700 | 4,549,600 | 4,550,100 |
| 準備預金残高 | 4,272,300 | | |
| 積み終了先 | 4,271,300 | 2月4日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 4,271,300 | 積数 | 500 |
| 非準備預金先 | 365,400 | 1日平均 | 0 |
| 積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数) | 4,133,500 | | |
| 準備預金進捗率 | 実績 99.99% | 日数 61.29% | |

●短期金融市场関連指標

| 2/3 | 無担保コール(速報) | | | | | | 壳買参考統計値 | 東京レポレート | |
|------------|------------|-------|-------|----|-------|-------|---------|-----------|----------|
| | 単位: % | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | | |
| O/N | 0.700 | 0.780 | 0.730 | 1W | | | 0.780 | T+0 0.742 | |
| T/N | | | | 2W | 0.710 | 0.800 | 0.727 | T+1 0.747 | |
| S/N | | | | 3W | | | | | |
| 2日 | | | | 1M | 0.780 | 0.850 | 0.786 | | |
| 3日 | | | | 2M | | | | | |
| 4日 | | | | 3M | | | | | |
| 5日 | | | | 4M | | | | | |
| 6日 | | | | 5M | | | | | |
| 有担保コール(速報) | | | | 6M | | | | 3M 0.740 | 3M 0.766 |
| O/N | | | 0.680 | 1Y | | | | 1Y 0.970 | 1Y 0.945 |

| 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 |
| 2.255 | +0.025 | 54,720.66 | +2,065.48 | 155.46-48 | 155.40-42 |
| 日付 | 1/27 | 1/28 | 1/29 | 1/30 | 2/2 |
| 日銀当預残 | 4,636,400 | 4,638,800 | 4,638,800 | 4,681,500 | 4,656,000 |
| 準備預金残 | 4,267,900 | 4,266,100 | 4,271,400 | 4,298,400 | 4,302,200 |
| マネタリーベース | 5,858,200 | 5,859,700 | 5,859,600 | 5,901,400 | 5,875,000 |
| 無担保O/N加重平均 | 0.736% | 0.727% | 0.727% | 0.727% | 0.727% |
| コール市場残高 | 137,108 | 128,178 | 128,094 | 125,517 | 134,119 |
| うち無担保 | 109,794 | 100,017 | 102,315 | 100,152 | 108,652 |
| うちO/N | 48,876 | 38,919 | 40,097 | 38,634 | 45,804 |
| うち有担保 | 27,314 | 28,161 | 25,779 | 25,365 | 25,467 |

●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・利回較差 | 棄分率 | 募入平均利回・利回較差 | 第Ⅰ非価格競争入札(億円) | 非競争入札(億円) |
|---------|-----|------|--------|-----------|------------|---------|---------|-------|-------------|----------|-------------|---------------|-----------|
| 10年利付国債 | 381 | 2.1% | 26,000 | 2026/2/4 | 2035/12/20 | 60,166 | 19,925 | 98.74 | 2.256% | 53.5840% | 98.79 | 2.249% | 6,050 |
| 交付税特会 | - | - | 13,000 | 2026/2/13 | 2026/8/14 | 34,103 | 13,000 | | 1.200% | 67.1100% | | 1.143% | - |

●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) | 按分率 | 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 |
|----------------------------|----------------|----------|-----------|---------|----------|---------------|---------------|-----|-----------------|-------------------|------|
| 米ドル資金供給 | | 2026/2/5 | 2026/2/13 | 3.890 | | 3 | 3 | | | | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファーフー) | | 2026/2/3 | 2026/2/4 | 0.550 | 0.550 | 3,203 | 3,203 | | 0.550 | 0.550 | |
| 共通担保資金供給(全店) <固定金利方式> | 8,000 | 2026/2/4 | 2026/2/18 | 0.750 | | 16,084 | 8,007 | | | | 49.8 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファーフー) | | 2026/2/3 | 2026/2/4 | 0.550 | 0.550 | 0 | 0 | | | | |
| 米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先) | 5,000 | 2026/2/4 | 2026/2/16 | 0.720 | 0.720 | 2 | 2 | | 0.720 | 0.720 | |

●2026年2月4日の予定

*2月の日銀当座預金増減要因見込み

*1月のISM非製造業景況指数

*1月のユーロ圏消費者物価指数速報値

◆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ことがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関東財務局長(登金) 第526号 日本証券業協会加入