

Central Daily Market Report

2026年2月6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2月6日 需給速報	2026年2月9日 需給予想	2026年2月10日 当社予想
銀行券	600	600	500
財政	▲ 13,600	▲ 2,700	▲ 3,000
資金過不足	▲ 13,000	▲ 2,100	▲ 2,500
金融調節	スタート	エンド	スタート
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			
貸出支援基金(貸)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 2,100	2,500	2,100
米ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	▲ 12,600	0	▲ 2,500
当座預金残高	4,543,900	4,543,900	4,541,400
準備預金残高	4,190,200		
積み終了先	4,190,200	2月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,190,200	積数	0
非準備預金先	353,700	1日平均	0
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	4,138,900		
準備預金進捗率	実績 100.00%	日数 77.42%	

●短期金融市場関連指標

2/6	無担保コール(速報)						短国	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	0.750	0.728	1W	0.731	0.860	0.770	
T/N				2W				
S/N				3W				
2日				1M	0.790	0.860	0.827	
3日				2M			0.960	
4日				3M			0.945	
5日				4M				
6日				5M				
有担保コール(速報)				6M				
O/N			0.680	1Y				

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	+0.005	54,253.68	+435.64	156.79-82	156.88-90
日付	1/30	2/2	2/3	2/4	2/5
日銀当預残	4,681,500	4,656,000	4,637,700	4,545,000	4,556,500
準備預金残	4,298,400	4,302,200	4,274,800	4,190,500	4,195,200
マネタリーベース	5,901,400	5,875,000	5,855,900	5,762,600	5,774,200
無担保O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.730%	0.727%	0.727%
コール市場残高	125,517	134,119	133,868	121,805	126,938
うち無担保	100,152	108,652	109,260	97,353	102,159
うちO/N	38,634	45,804	45,692	34,135	38,831
うち有担保	25,365	25,467	24,608	24,452	24,779

●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	1360	-	47,000	2026/2/9	2026/5/11	116,078	36,070.7	99,811.5	0.7574%	54.4436%	99,813.7	0.7486%	10,929	

●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 ・利回り較差 ・価格較差	全取レート ・利回り較差 ・価格較差	平均落札率 ・利回り較差 ・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)		2026/2/6	2026/2/9	0.450	2,325	2,325			0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/2/6	2026/2/9	0.450	0	0					

●2026年2月9日の予定

*12月の毎月勤労統計調査速報

*12月の国際収支

*1月の景気ウォッチャー調査

*国庫短期証券(1361回)入札

(6か月、38,000億円、2/10発行)

◆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