

Central Daily Market Report

2026年1月5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1月5日 需給速報	2026年1月6日 需給予想	2026年1月7日 当社予想	
銀行券	2,200	3,500	5,000	
財政	4,300	▲ 6,800	▲ 63,000	
資金過不足	6,500	▲ 3,300	▲ 58,000	
金融調節	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				
CP等買入				
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援				
社債等買入				
気候変動対応オペ				
国債補完供給	▲ 3,500	1,700	3,500	
当座預金残高	4,714,400	4,714,600	4,648,600	
準備預金残高	4,313,900			
積み終了先	4,313,900			
超過準備	4,313,600			
非準備預金先	400,500			
当座増減	4,700	200	▲ 66,000	
積み期間(12/16~1/15日)の所要準備額(積数)			4,132,600	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	67.74%

●2026年1月5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、引き続き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1W~2M程度の期間で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.74~0.755%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>

5日のアウトライト市場は、6M物、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

1/5 単位：%	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	0.780	0.727	1W	0.734	0.860	0.793	T+0	0.742
T/N				2W	0.785	0.870	0.805	T+1	0.750
S/N				3W			0.850		
2日				1M	0.780	0.840	0.810	1W	0.739
3日				2M				2W	0.736
4日				3M				3W	0.736
5日				4M			0.950	1M	0.738
6日				5M				3M	0.744
有担保コール(速報)				6M				6M	0.772
O/N			0.680	1Y				1Y	0.881

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
2.116	+0.046	51,832.80	+1,493.32	156.99-01	156.97-99
日付					
日付	12/24	12/25	12/26	12/29	12/30
日銀当預残	4,711,100	4,736,500	4,732,300	4,721,500	4,709,700
準備預金残	4,305,800	4,332,000	4,319,400	4,307,300	4,289,700
マネタリーベース	5,957,400	5,986,000	5,984,200	5,974,600	5,962,100
無担O/N加重平均	0.727%	0.728%	0.727%	0.728%	0.727%
コール市場残高	100,830	102,244	96,687	98,989	99,108
うち無担	73,416	75,432	72,158	74,898	75,990
うちO/N	27,014	28,280	26,605	27,865	29,002
うち有担	27,414	26,812	24,529	24,091	23,118

●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(午前オファー分)		2026/1/5	2026/1/6		0.550	3,404	3,404		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/5	2026/1/6		0.550	300	300		0.550	0.550	

●2026年1月6日の予定

*12月のマネタリーベース *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*国庫短期証券(第1353回)入札 (3か月、47,000億円、1/7発行) *10年利付国債入札 (26,000億円、1/7発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、1/16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たい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の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