

Central Daily Market Report

2026年1月6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1月6日 需給速報	2026年1月7日 需給予想	2026年1月8日 当社予想	
銀行券	3,700	2,700	3,000	
財政	2,200	▲ 60,000	2,000	
資金過不足	5,900	▲ 57,300	5,000	
金融調節	スタート	スタート	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				
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				
国債補充供給	▲ 3,000	2,100	3,000	
当預増減	5,000	▲ 54,300	5,000	
当座預金残高	4,719,400	4,665,100	4,670,100	
準備預金残高	4,322,500			
積み終了先	4,322,400	1月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,322,400	積数	100	
非準備預金先	396,900	1日平均	0	
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	70.97%

●2026年1月6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、2W~3M程度の期間で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.745~0.755%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>

6日はTDB3M物(第1353回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは強含みで推移した。このほか、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

1/6	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	0.731	0.732	0.732	T+0	0.731	
T/N				2W	0.710	0.730	0.726	T+1	0.749	
S/N				3W						
2日				1M	0.780	0.920	0.793	1W	0.739	
3日				2M			0.830	2W	0.738	
4日				3M	0.810	0.880	0.866	3W	0.738	
5日				4M				1M	0.739	
6日				5M				3M	0.746	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.776	
O/N			0.680	1Y				1Y	0.884	

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	
2.120	+0.004	52,518.08	+685.28	156.60-62	156.32-34	
日付		12/25	12/26	12/29	12/30	1/5
日銀当預残	4,736,500	4,732,300	4,721,500	4,709,700	4,714,400	
準備預金残	4,332,000	4,319,400	4,307,300	4,289,700	4,315,500	
マネタリーベース	5,986,000	5,984,200	5,974,600	5,962,100	5,964,600	
無担O/N加重平均	0.728%	0.727%	0.728%	0.727%	0.727%	
コール市場残高	102,244	96,687	98,989	99,108	104,778	
うち無担	75,432	72,158	74,898	75,990	78,874	
うちO/N	28,280	26,605	27,865	29,002	30,221	
うち有担	26,812	24,529	24,091	23,118	25,904	

●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	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	1353	-	47,000	2026/1/7	2026/4/6	115,872	36,913.7	99,8295	0.7004%	55.4514%	99,8314	0.6926%	10,086	
10年利付国債	381	2.1%	26,000	2026/1/7	2035/12/20	64,702	19,585	99.99	2.101%	90.6569%	100.04	2.095%	6,408	3.6

●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
米ドル資金供給		2026/1/8	2026/1/15	3.890		0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/1/6	2026/1/7		0.550	3,216	3,216		0.550	0.550	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2026/1/7	2026/1/21	0.750		12,550	8,005				63.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/6	2026/1/7		0.550	50	50		0.550	0.550	

●2026年1月7日の予定

*1月の日銀当座預金増減要因見込み	*12月のISM非製造業景況指数 *10月の米製造業受注 *12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よう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場合があります。金融商品取引法に基づきお渡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 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入