

# Central Daily Market Report

2026年1月7日(水)

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7日 需給速報	2026年1月8日 需給予想	2026年1月9日 当社予想			
銀行券	2,900	2,500	2,000			
財政	▲ 60,000	4,600	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 57,100	7,100	▲ 5,000			
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	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			6,600			
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	▲ 3,500	2,500	3,500			
※下の資金需給は前日比速報値						
当預増減	▲ 58,100	17,200	▲ 5,000			
当座預金残高	4,661,300	4,678,500	4,673,500			
準備預金残高	4,268,000					
積み終了先	4,268,000			1月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,268,000			積数	100	
非準備預金先	393,300			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	74.19%		

## ●2026年1月7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>

7日のアウトライト市場は、3M物、6M物、1Y物で出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

## ●入札結果

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。

## ●短期金融市場関連指標

1/7	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	0.721	0.734	0.729		T+0	0.746	
T/N				2W			0.800		T+1	0.745	
S/N				3W							
2日				1M					1W	0.740	
3日				2M					2W	0.739	
4日				3M					3W	0.739	
5日				4M					1M	0.740	
6日				5M				3M	0.746		
有担保コール(速報)				6M				6M	0.780		
O/N			0.680	1Y				1Y	0.885		

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	0.000	51,961.98	▲ 556.10	156.65-66	156.48-49
日付	12/26	12/29	12/30	1/5	1/6
日銀当預残	4,732,300	4,721,500	4,709,700	4,714,400	4,719,400
準備預金残	4,319,400	4,307,300	4,289,700	4,315,500	4,323,400
マネタリーベース	5,984,200	5,974,600	5,962,100	5,964,600	5,965,900
無担O/N加重平均	0.727%	0.728%	0.727%	0.727%	0.727%
コール市場残高	96,687	98,989	99,108	104,778	104,419
うち無担	72,158	74,898	75,990	78,874	77,913
うちO/N	26,605	27,865	29,002	30,221	27,355
うち有担	24,529	24,091	23,118	25,904	26,506

## ●オペ結果

種類	オフア額 (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
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2026/1/8				1,853	1,003	▲0.004		0.005	72.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,700	2026/1/8				6,152	2,703	▲0.008		▲0.007	81.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,450	2026/1/8				7,625	2,454	▲0.008		▲0.008	82.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	950	2026/1/8				2,412	951	0.031		0.038	15.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2026/1/7	2026/1/8		0.450	3,854	3,854		0.450	0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2026/1/7	2026/1/8		0.450	0	0				

## ●2026年1月8日の予定

*11月の毎月勤労統計調査速報 *12月の消費動向調査	*11月の米消費者信用残高 *10月の米貿易収支 *10月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1354回)入札 (6か月、38,000億円、1/13発行) *30年利付国債入札 (7,000億円、1/9発行) *エネルギー対策特別会計借入 (7,455億円、1/20借入)
--------------------------------	--	--

◆本資料は信頼できるとさ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り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