

Central Daily Market Report

2026年1月8日(木)

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8日 需給速報	2026年1月9日 需給予想	2026年1月13日 当社予想			
銀行券	2,600	2,500	3,500			
財政	9,600	▲ 8,800	▲ 6,500			
資金過不足	12,200	▲ 6,300	▲ 3,000			
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						
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						
国債補完供給	▲ 2,100	3,500	2,100			
※下の資金需給は国債補完供給						
当増減	20,200	▲ 4,200	▲ 3,000			
当座預金残高	4,681,500	4,677,300	4,674,300			
準備預金残高	4,279,800					
積み終了先	4,279,800			1月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,279,800			積数	0	
非準備預金先	401,700			1日平均	0	
積み期間(12/16~1/15日)の所要準備額(積数)					4,128,200	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	77.42%		

●2026年1月8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、3W~1M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>

8日はTDB6M物(第1354回)の入札が実施され、事前予想より強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは堅調に推移した。このほか、3M物と1Y物でも出合いが見られた。

<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

1/8	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	0.775	0.729	1W	0.726	0.860	0.766	T+0	0.739	
T/N				2W			0.728	T+1	0.742	
S/N				3W			0.840			
2日				1M			0.830	1W	0.738	
3日				2M				2W	0.738	
4日				3M				3W	0.738	
5日				4M				1M	0.738	
6日			0.850	5M				3M	0.745	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.779	
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
2.075	▲ 0.045	51,117.26	▲ 844.72	156.69-71	156.46-48
日付					
	12/29	12/30	1/5	1/6	1/7
日銀当預残	4,721,500	4,709,700	4,714,400	4,719,400	4,661,300
準備預金残	4,307,300	4,289,700	4,315,500	4,323,400	4,268,000
マネタリーベース	5,974,600	5,962,100	5,964,600	5,965,900	5,904,900
無担O/N加重平均	0.728%	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%
コール市場残高	98,989	99,108	104,778	104,419	109,389
うち無担	74,898	75,990	78,874	77,913	81,189
うちO/N	27,865	29,002	30,221	27,355	28,871
うち有担	24,091	23,118	25,904	26,506	28,200

●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	1354	-	38,000	2026/1/13	2026/7/10	111,758	29,318.5	99.624	0.7739%	54.9563%	99.626	0.7697%	8,681	
30年利付国債	89	3.4%	7,000	2026/1/9	2055/12/20	16,473	5,249	99.15	3.457%	37.9818%	99.30	3.447%	1,740	
エネルギー対策	-	-	7,455	2026/1/20	2027/1/20	28,890	7,455		1.100%	10.5058%		1.048%		

●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)	着札総額(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	平均着札レート・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)		2026/1/8	2026/1/9		0.450	2,268	2,268		0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/8	2026/1/9		0.450	0	0				

●2026年1月9日の予定

*11月の全世帯家計調査	*12月の米雇用統計	*国庫短期証券(第1355回)入札
*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*9・10月の米新規住宅着工件数	(3か月、47,000億円、1/13発行)
*11月の景気動向指数速報	*1月のミシガン大学消費者信頼感指数速報	

◆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場合があります。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