

Central Daily Market Report

2026年1月9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1月9日 需給速報	2026年1月13日 需給予想	2026年1月14日 当社予想	
銀行券	2,700	2,200	2,000	
財政	▲ 6,500	▲ 9,000	▲ 13,000	
資金過不足	▲ 3,800	▲ 6,800	▲ 11,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出				
全店共通				
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	▲ 5,800	2,100	5,800	
※ドム資金供給額(国債買入)				
当預増減	▲ 7,500	▲ 1,000	▲ 11,000	
当座預金残高	4,674,000	4,673,000	4,662,000	
準備預金残高	4,279,300			
積み終了先	4,279,300		1月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,279,300		積数	0
非準備預金先	394,700		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	90.32%

●2026年1月9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、0.75~0.755%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>

9日はTDB3M物(第1355回)の入札が実施され、事前予想よりも甘めな結果となったが、結果発表後のセカンダリーでは底堅く推移した。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、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

1/9 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	0.720	0.734	0.725	T+0	0.743	
T/N				2W	0.723	0.785	0.732	T+1	0.750	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.739	
3日				2M				2W	0.738	
4日				3M				3W	0.738	
5日			0.720	4M				1M	0.739	
6日				5M				3M	0.695	
有担保コール(速報)				6M		1.060		6M	0.754	
O/N			0.680	1Y				1Y	0.890	

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
2.090	+0.015	51,939.89	+822.63	156.86-88	157.48-50
日付					
12/30	1/5	1/6	1/7	1/8	
日銀当預残	4,709,700	4,714,400	4,719,400	4,661,300	4,681,500
準備預金残	4,289,700	4,315,500	4,323,400	4,268,000	4,280,200
マネタリーベース	5,962,100	5,964,600	5,965,900	5,904,900	5,922,500
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.729%
コール市場残高	99,108	104,778	104,419	109,389	110,944
うち無担	75,990	78,874	77,913	81,189	82,587
うちO/N	29,002	30,221	27,355	28,871	29,779
うち有担	23,118	25,904	26,506	28,200	28,357

●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非償付額(億円)	非償付率
国庫短期証券	1355	-	47,000	2026/1/13	2026/4/13	106,739	36,613.6	99,8280	0.6987%	80.7392%	99.8337	0.6755%	10,386	

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/1/9	2026/1/13		0.450	6,149	6,149		0.450	0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/9	2026/1/13		0.450	41	41		0.450	0.450	

●2026年1月13日の予定

*11月の国際収支	*12月の米財政収支
*12月の景気ウォッチャー調査	*12月の米消費者物価指数
	*9・10月の米新規住宅販売件数

◆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