

Central Daily Market Report

2026年1月13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13日 需給速報	2026年1月14日 需給予想	2026年1月15日 当社予想			
銀行券	2,100	2,900	2,000			
財政	▲ 21,500	▲ 9,700	▲ 28,000			
資金過不足	▲ 19,400	▲ 6,800	▲ 26,000			
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						
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	▲ 3,900	5,800	3,900			
※ドル資金需給速報参照						
当預増減	▲ 17,500	▲ 2,900	▲ 26,000			
当座預金残高	4,656,500	4,653,600	4,627,600			
準備預金残高	4,267,100					
積み終了先	4,267,100			1月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,267,100			積数	0	
非準備預金先	389,400			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	93.55%		

●2026年1月13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、証券業態の調達による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>

13日のアウトライト市場は、3M物と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推移した。

●短期金融市場関連指標

1/13	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
単位: %	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	0.770	0.810	0.776	T+0	0.746	
T/N				2W	0.720	0.790	0.730	T+1	0.749	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.741	
3日				2M				2W	0.739	
4日				3M			0.850	3W	0.739	
5日				4M				1M	0.740	
6日				5M				3M	0.747	
有担保コール(速報)				6M			1.000	6M	0.781	
O/N			0.680	1Y				1Y	0.886	

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
2.160	+0.070	53,549.16	+1,609.27	157.99-01	158.93-96
日付	1/5	1/6	1/7	1/8	1/9
日銀当預残	4,714,400	4,719,400	4,661,300	4,681,500	4,674,000
準備預金残	4,315,500	4,323,400	4,268,000	4,280,200	4,279,500
マネタリーベース	5,964,600	5,965,900	5,904,900	5,922,500	5,912,300
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.729%	0.727%
コール市場残高	104,778	104,419	109,389	110,944	110,352
うち無担	78,874	77,913	81,189	82,587	82,219
うちO/N	30,221	27,355	28,871	29,779	29,291
うち有担	25,904	26,506	28,200	28,357	28,133

●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非償付競争入札(億円)	第1非償付競争入札(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
米ドル資金供給		2026/1/15	2026/1/22	3.890		0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/1/13	2026/1/14		0.550	4,257	4,257		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/13	2026/1/14		0.550	10	10		0.550	0.550	

●2026年1月14日の予定

*12月のマネーストック	*米ベージュブック	*5年利付国債入札(25,000億円、1/15発行)
	*11月の米生産者物価指数	
	*12月の米中古住宅販売件数	
	*11月の米小売売上高	
	*10月の米企業在庫	

◆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