

Central Daily Market Report

2026年1月15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15日 需給速報	2026年1月16日 需給予想	2026年1月19日 当社予想			
銀行券	2,100	2,100	2,500			
財政	▲ 22,600	7,500	▲ 10,500			
資金過不足	▲ 20,500	9,600	▲ 8,000			
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						
国債補充供給	▲ 1,700	2,500	1,700			
※下の資金需給は担保資産別						
当預増減	▲ 19,700	17,900	▲ 8,000			
当座預金残高	4,621,400	4,639,300	4,631,300			
準備預金残高	4,234,700					
積み終了先	4,234,700			1月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,234,700			積数	4,133,500	
非準備預金先	386,700			1日平均	133,300	
積み期間(1/16~2/15日)の所要準備額(積数)					4,133,500	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2026年1月15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、証券業態の調達を中心に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>

15日のアウトライト市場は、3M物と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

1/15 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	0.726	0.780	0.738		T+0	0.744
T/N				2W	0.800	0.900	0.877		T+1	0.749
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.741	
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	0.781	
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	▲ 0.020	54,110.50	▲ 230.73	158.43-45	158.58-59

日付	1/7	1/8	1/9	1/13	1/14
日銀当預残	4,661,300	4,681,500	4,674,000	4,656,500	4,641,100
準備預金残	4,268,000	4,280,200	4,279,500	4,270,200	4,248,100
マネタリーベース	5,904,900	5,922,500	5,912,300	5,892,600	5,874,200
無担O/N加重平均	0.727%	0.729%	0.727%	0.727%	0.727%
コール市場残高	109,389	110,944	110,352	111,400	114,636
うち無担	81,189	82,587	82,219	84,007	87,243
うちO/N	28,871	29,779	29,291	30,629	30,545
うち有担	28,200	28,357	28,133	27,393	27,393

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2026/1/23	2026/7/24	40,963	13,000		0.950%	57.0310%		0.926%		-

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,700	2026/1/16				6,221	2,703	0.001		0.001	83.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	2,600	2026/1/16				5,544	2,606	▲0.028		▲0.027	86.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	950	2026/1/16				1,733	951	▲0.026		▲0.021	66.0
国債買入(残存期間25年超)	750	2026/1/16				1,240	751	▲0.029		▲0.018	73.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/1/15	2026/1/16		0.550	1,838	1,838		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/15	2026/1/16		0.550	60	60		0.550	0.550	

●2026年1月16日の予定

*12月の米鉱工業生産	*国庫短期証券(1356回)入札(3か月、47,000億円、1/19発行)	*流動性供給入札(6,500億円、1/19発行)
-------------	---------------------------------------	--------------------------

◆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