

Central Daily Market Report

2026年1月16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16日 需給速報	2026年1月19日 需給予想	2026年1月20日 当社予想
銀行券	2,200	1,300	2,000
財政	6,300	▲ 12,400	2,000
資金過不足	8,500	▲ 11,100	4,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		▲ 100	
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 2,300	1,700	2,300
米ドル資金供給所担保国債供給			
当預増減	14,500	▲ 8,900	4,000
当座預金残高	4,635,900	4,627,000	4,631,000
準備預金残高	4,258,500		
積み終了先	4,206,100	1月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,912,400	積数	95,300
非準備預金先	377,400	1日平均	3,400
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 97.69%	日数 9.68%	

●2026年1月16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、出会いの水準は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、0.755%程度での出会いとなった。SCI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〉

16日は、TDB3M物(第1356回)の入札が実施され、事前予想対比で無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりで推移した。

〈CP市場〉

CP発行市場は、複数の業態で発行が実施され、大型発行も見られた。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

1/16	無担保コール(速報)						壳買参考統計値	東京レポレート 平均値	JGB新発10年債(%)	日経平均株価(円)	為替(ドル/円)
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均				
O/N	0.700	0.728	0.727	1W	0.725	0.860	0.761		T+0 0.743	53,936.17 ▲ 174.33	158.59-61 158.16-18
T/N				2W	0.780	0.880	0.795		T+1 0.750		
S/N				3W					1W 0.742		
2日				1M					2W 0.740		
3日				2M					3W 0.740		
4日		0.783		3M					1M 0.741		
5日				4M					3M 0.700		
6日				5M					3M 0.748		
有担保コール(速報)				6M					6M 0.750		
O/N		0.680	1Y						1Y 0.920		
									0.891		

日付	1/8	1/9	1/13	1/14	1/15	JGB新発10年債(%)	日経平均株価(円)	為替(ドル/円)
						直近値		
日銀当預残	4,681,500	4,674,000	4,656,500	4,641,100	4,621,400	4.681,500	4,674,000	4,656,500
準備預金残	4,280,200	4,279,500	4,270,200	4,248,100	4,235,700	4,280,200	4,279,500	4,270,200
マネタリーベース	5,922,500	5,912,300	5,892,600	5,874,200	5,852,500	5,922,500	5,912,300	5,892,600
無担保O/N加重平均	0.729%	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.729%	0.727%	0.727%
コール市場残高	110,944	110,352	111,400	114,636	115,776	110,944	110,352	111,400
うち無担保	82,587	82,219	84,007	87,243	88,061	82,587	82,219	84,007
うちO/N	29,779	29,291	30,629	30,545	31,063	29,779	29,291	30,629
うち有担保	28,357	28,133	27,393	27,393	27,715	28,357	28,133	27,393

●入札結果

名称	回号	表面利回	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	率分率	募入平均利回	利回較差	第I非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1356	-	47,000	2026/1/19	2026/4/20	116,530	36,813.6	99,8225	0.7132%	92.7692%	99.8238	0.7079%	10,186	
流動性供給	445	-	6,500	2026/1/19	-	16,735	6,490		0.018%	86.2119%		0.013%		

●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	賞付利率(%)	利回り(%)※1	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分率	金取レート・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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/1/16	2026/1/19	0.450	2,347	2,347	2,347	0.450	0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/16	2026/1/19	0.450	95	95	95	0.450	0.450	0.450	

●2026年1月19日の予定

*11月の機械受注統計調査
*11月の石油等消費動態統計
*11月の第3次産業活動指標

*12月のユーロ圏消費者物価指数改訂値
*NY祝日(Birthday of Martin Luther King,Jr)

*国庫短期証券(1357回)入札
(1Y、33,000億円、1/20発行)

◆本資料は信頼できると思わ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。
◆本資料は何ら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ものがあります。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