

Central Daily Market Report

2026年1月19日(月)
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19日 需給速報	2026年1月20日 需給予想	2026年1月21日 当社予想
銀行券	1,400	1,900	1,500
財政	▲12,300	12,100	▲14,000
資金過不足	▲10,900	14,000	▲12,500

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						▲8,000
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		▲100		▲300		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲2,900	2,300		2,900		

当増減	▲11,600	16,600	▲20,500
-----	---------	--------	---------

当座預金残高	4,624,300	4,640,900	4,620,400
準備預金残高	4,247,300		
積み終了先	4,229,100		
超過準備	4,218,700		
非準備預金先	377,000		
1月20日以降の残り所要積立額			積数 65,800
			1日平均 2,400

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 98.41%	日数 12.90%
---------	-----------	-----------

●2026年1月19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、前週に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、0.745~0.755%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>

19日のTDB1Y物(第1357回)入札は無難な結果となり、その後のセカンダリーでも底堅く推移した。このほか、3M物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で発行が見られた。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

1/19	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	0.728	0.727	1W	0.720	0.850	0.729	T+0	0.746	
T/N				2W				T+1	0.750	
S/N				3W						
2日				1M			0.810	1W	0.741	
3日				2M				2W	0.741	
4日				3M			0.870	3W	0.741	
5日				4M				1M	0.741	
6日				5M				3M	0.747	
有担保コール(速報)				6M			0.750	6M	0.789	
O/N			0.680	1Y			0.965	1Y	0.898	

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
2.270	+0.090	53,583.57	▲352.60	157.56-58	158.06-08

日付	1/9	1/13	1/14	1/15	1/16
日銀当預残	4,674,000	4,656,500	4,641,100	4,621,400	4,635,900
準備預金残	4,279,500	4,270,200	4,248,100	4,235,700	4,258,900
マネタリーベース	5,912,300	5,892,600	5,874,200	5,852,500	5,864,700
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%
コール市場残高	110,352	111,400	114,636	115,776	116,455
うち無担	82,219	84,007	87,243	88,061	87,578
うちO/N	29,291	30,629	30,545	31,063	30,740
うち有担	28,133	27,393	27,393	27,715	28,877

●入札結果

名称	回数	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非競争額(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1357	-	33,000	2026/1/20	2027/1/20	93,939	26,122.8	99.033	0.9764%	95.7342%	99.040	0.9693%	6,877	

●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・利回較差・価格較差	全取レート・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)		2026/1/19	2026/1/20		0.550	3,123	3,123		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/1/19	2026/1/20		0.550	0	0				

●2026年1月20日の予定

*20年利付国債入札 (8,000億円、1/21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いますが、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よう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