

# Central Daily Market Report

2025年1月6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	2025年1月6日 需給速報	2025年1月7日 需給予想	2025年1月8日 当社予想		
銀行券	2,900	3,200	3,200		
財政	10,700	▲ 7,500	▲ 48,000		
資金過不足	13,600	▲ 4,300	▲ 44,800		
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	
貸出					
全店共通		▲ 30,000		▲ 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					
気候変動対応オペ					
E T F買入					
国債補完供給	▲ 10,300	8,000	10,300		
当預増減	▲ 18,700	6,000	▲ 52,800		
当座預金残高	5,296,500	5,302,500	5,249,700		
準備預金残高	4,793,800				
積み終了先	4,793,100			1月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,793,000			積数	1,600
非準備預金先	502,700			1日平均	200
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					4,063,800
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	70.97%	

## ●2025年1月6日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、引き続き邦銀業態を中心に堅調な資金調達ニーズが見られ、出合い水準は0.226~0.227%程度の横ばい圏で推移した。年末年始要因が剥落したことにより、調達を再開する動きも散見されたが、出合い水準に大きな変化は見られなかった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レボ市場>

GC T/Nは、0.25%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>

6日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、一部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

1/6	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	0.219	0.228	0.227	1W	0.226	0.400	0.264	T+0	0.246	
T/N				2W	0.227	0.400	0.237	T+1	0.245	
S/N				3W	0.280	0.400	0.308	1W	0.226	
2日				1M	0.320	0.350	0.346	2W	0.229	
3日				2M			0.520	3W	0.232	
4日				3M				1M	0.241	
5日				4M				3M	0.326	
6日				5M				6M	0.397	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.494	
O/N			0.180	1Y						

JGB新発10年債			日経平均株価			ドル/円	
直近値	前日比		終値	前日比		為替(9時)	為替(17時)
1.125	+0.035		39,307.05	▲ 587.49		157.51-53	157.66-68
日付	12/24	12/25	12/26	12/27	12/30		
日銀当預残	5,323,200	5,324,700	5,342,000	5,328,200	5,315,200		
準備預金残	4,818,400	4,837,800	4,840,900	4,830,000	4,812,000		
マネタリーベース	6,603,500	6,607,600	6,627,600	6,615,800	6,602,900		
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%		
コール市場残高	116,695	115,021	113,436	115,335	111,524		
うち無担	76,242	75,096	74,102	76,029	72,880		
うちO/N	29,756	29,880	28,686	30,063	29,234		
うち有担	40,453	39,925	39,334	39,306	38,644		

## ●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非価格競争入札(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	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)		2025/1/6	2025/1/7	▲0.050	10,520	10,520		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/6	2025/1/7	▲0.050	0	0				

## ●2025年1月7日の予定

* 12月のマネタリーベース	* 12月のISM非製造業景況指数	* 国庫短期証券(1278回)入札(3ヶ月、45,000億円、1/8発行)
* 財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	* 11月の米貿易収支	* 10年利付国債入札(26,000億円、1/8発行)
	* 12月のユーロ圏消費者物価指数速報値	* 交付税特別会計借入(13,000億円、1/16借入)

◆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場合があります。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