

Central Daily Market Report

2025年1月8日(水)

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8日 需給速報	2025年1月9日 需給予想	2025年1月10日 当社予想			
銀行券	2,900	2,200	2,100			
財政	▲ 49,200	▲ 4,500	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 46,300	▲ 2,300	▲ 4,900			
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	▲ 8,000				▲ 20,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			10,300			
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	▲ 10,200	10,400	10,200			
当預増減	▲ 46,100	18,200	▲ 24,900			
当座預金残高	5,248,900	5,267,100	5,242,200			
準備預金残高	4,737,600					
積み終了先	4,737,100			1月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,737,100			積数	500	
非準備預金先	511,300			1日平均	100	
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	99.99%	日数	77.42%		

●2025年1月8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がみられ、出合い水準は概ね0.226~0.227%程度の横ばい圏で推移した。
ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

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>

8日のアウトライ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、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

1/8	無担保コール(速報)							短国		東京レポレート		JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	最低	最高	平均	直近値	前日比	終値	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	0.219	0.275	0.231	1W	0.390	0.450	0.413			T+0	0.248	1.175	+0.035	39,981.06	▲ 102.24	158.21-24	158.11-13
T/N				2W						T+1	0.246						
S/N				3W						1W	0.234						
2日				1M						2W	0.235						
3日				2M						3W	0.237						
4日				3M						1M	0.246						
5日			0.225	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						1Y	0.494						

日付	12/26	12/27	12/30	1/6	1/7
日銀当預残	5,342,000	5,328,200	5,315,200	5,296,500	5,295,000
準備預金残	4,840,900	4,830,000	4,812,000	4,794,000	4,785,600
マネタリーベース	6,627,600	6,615,800	6,602,900	6,581,200	6,576,500
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	113,436	115,335	111,524	116,098	116,923
うち無担	74,102	76,029	72,880	75,719	76,704
うちO/N	28,686	30,063	29,234	28,308	28,128
うち有担	39,334	39,306	38,644	40,379	40,219

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2025/1/9			9,006	3,001	0.019		0.020	45.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2025/1/9			7,945	3,005	0.025		0.027	69.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,250	2025/1/9			8,927	3,258	0.031		0.032	76.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2025/1/9			3,591	1,507	0.032		0.034	48.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/1/8	2025/1/9	0.050	10,493	10,493		0.050	0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/8	2025/1/9	0.050	0	0				

●2025年1月9日の予定

* 11月の毎月勤労統計調査速報	* 11月の米卸売売上高	* 国庫短期証券(1279回)入札(6ヶ月、35,000億円、1/10発行)	* エネルギー対策特別会計借入(7,427億円、1/20借入)
		* 30年利付国債入札(9,000億円、1/10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