

Central Daily Market Report

2025年1月10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	2025年1月10日 需給速報	2025年1月14日 需給予想	2025年1月15日 当社予想	
銀行券	3,500	2,600	2,000	
財政	▲ 9,100	▲ 9,800	▲ 35,000	
資金過不足	▲ 5,600	▲ 7,200	▲ 33,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出	エンド	エンド	エンド	
全店共通	▲ 20,000	▲ 20,000		
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入				
CP等買入	▲ 100	▲ 100		
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	▲ 5,600	8,300	5,600	
当預増減	▲ 23,000	▲ 21,700	▲ 33,000	
当座預金残高	5,240,400	5,218,700	5,185,700	
準備預金残高	4,726,100			
積み終了先	4,726,100	1月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,726,100	積数	0	
非準備預金先	514,300	1日平均	0	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額			4,067,000	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	93.55%

●2025年1月10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、出合い水準は概ね0.226~0.227%程度の横ばい圏で推移した。連休を挟む取引となったものの、出合いレート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、0.245~0.25%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>

10日はTDB3M物(第1280回)の入札が実施され、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と推移した。
このほか、6M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

1/10	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	0.200	0.228	0.227	1W	0.226	0.400	0.267	T+0	0.243	
T/N				2W			0.300	T+1	0.248	
S/N				3W				1W	0.240	
2日				1M				2W	0.239	
3日				2M				3W	0.243	
4日				3M			0.610	1M	0.249	
5日				4M				3M	0.325	
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)
1.195	+0.025	39,190.40	▲ 414.69	158.02-05	158.38-40
日付	12/30	1/6	1/7	1/8	1/9
日銀当預残	5,315,200	5,296,500	5,295,000	5,248,900	5,263,400
準備預金残	4,812,000	4,794,000	4,785,600	4,734,900	4,741,700
マネタリーベース	6,602,900	6,581,200	6,576,500	6,527,500	6,539,800
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.231%	0.232%
コール市場残高	111,524	116,098	116,923	123,258	124,466
うち無担	72,880	75,719	76,704	81,969	83,645
うちO/N	29,234	28,308	28,128	31,713	32,909
うち有担	38,644	40,379	40,219	41,289	40,821

●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1280	-	45,000	2025/1/14	2025/4/14	121,691	34,276.6	99.9380	0.2516%	25.4896%	99.9408	0.2402%	10,723

●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)		2025/1/10	2025/1/14	▲0.050	5,693	5,693		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/10	2025/1/14	▲0.050	0	0				

●2025年1月13日の予定

* 成人の日	* 12月の米財政収支
--------	-------------

●2025年1月14日の予定

* 11月の国際収支	* 12月の米生産者物価指数	* 5年利付国債入札(23,000億円、1/15発行)
* 12月の景気ウォッチャー調査		

◆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