

Central Daily Market Report

2025年1月14日(火)

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14日 需給速報	2025年1月15日 需給予想	2025年1月16日 当社予想			
銀行券	2,400	2,400	2,000			
財政	▲ 11,500	▲ 31,800	0			
資金過不足	▲ 9,100	▲ 29,400	2,000			
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		▲ 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				
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	▲ 5,400	5,600		5,400		
※ドル資金供給用国債補完供給						
当預増減	▲ 29,000	▲ 24,000	▲ 18,000			
当座預金残高	5,211,400	5,187,400	5,169,400			
準備預金残高	4,700,600					
積み終了先	4,700,600			1月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,700,600			積数	0	
非準備預金先	510,800			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	96.77%		

●2025年1月14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。
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>

14日のアウトライ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、複数の業態で発行が実施された。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

1/14	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	売買取参考統計値	平均値	
O/N	0.220	0.228	0.227	1W	0.300	0.450	0.314	T+0	0.244
T/N				2W				T+1	0.245
S/N				3W				1W	0.240
2日				1M				2W	0.241
3日				2M				3W	0.247
4日				3M	0.530	0.610	0.557	1M	0.255
5日				4M				3M	0.330
6日				5M				6M	0.397
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.496
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)
1.240	+0.045	38,474.30	▲ 716.10	157.31-34	157.52-54
日付	1/6	1/7	1/8	1/9	1/10
日銀当預残	5,296,500	5,295,000	5,248,900	5,263,400	5,240,400
準備預金残	4,794,000	4,785,600	4,734,900	4,741,700	4,726,100
マネタリーベース	6,581,200	6,576,500	6,527,500	6,539,800	6,513,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.231%	0.232%	0.227%
コール市場残高	116,098	116,923	123,258	124,466	124,985
うち無担	75,719	76,704	81,969	83,645	82,190
うちO/N	28,308	28,128	31,713	32,909	30,964
うち有担	40,379	40,219	41,289	40,821	42,795

●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非償格募入札(億円)	非償募入札(億円)
5年利付国債	175	0.9%	23,000	2025/1/15	2029/12/20	66,357	17,390	100.10	0.878%	28.5121%	100.11	0.876%	5,604	1.05

●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
米ドル資金供給		2025/1/16	2025/1/23	4.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/1/14	2025/1/15	▲ 0.050	5,461	5,461		▲ 0.050	▲ 0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/14	2025/1/15	▲ 0.050	62	62		▲ 0.050	▲ 0.050	

●2025年1月15日の予定

* 12月のマネーストック	* 12月の米消費者物価指数	* 交付税特別会計借入(13,000億円、1/24借入)
* 11月の特定サービス産業動態統計速報	* 米ページブック	
	* 12月の英消費者物価指数	

◆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