

Central Daily Market Report

2025年1月17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17日 需給速報	2025年1月20日 需給予想	2025年1月21日 当社予想
銀行券	2,800	1,500	2,000
財政	4,400	1,000	3,000
資金過不足	7,200	2,500	5,000
金融調節	スタート	スタート	スタート
貸出			
全店共通			▲1,200
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入		▲200	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲200
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲7,500	3,600	7,500
当預増減	3,100	8,600	5,000
当座預金残高	5,186,100	5,194,700	5,199,700
準備預金残高	4,689,000		
積み終了先	4,668,300		1月20日以降の残り所要積立額
超過準備	4,489,600		積数 36,700
非準備預金先	497,100		1日平均 1,400
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			4,074,100
準備預金進捗率	実績 99.10%	日数 12.90%	

●2025年1月17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、週末3日積みの取引となったこともあり、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たものの、出合い水準に大きな変化はなく、概ね0.226~0.227%程度の横ばい圏で推移した。ターム物の取引は閑散であった。

＜レポ市場＞

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＞

17日はTDB3M物(第1282回)の入札が実施され、前回債(1280回)からレートが大きく上昇する結果となったものの、その後のセカンダリーでは、小じっかりで推移した。このほか、6M物と1Y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

1/17	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	終値	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	0.215	0.228	0.227	1W	0.310	0.400	0.364		T+0	0.242	1.200	0.0	38,451.46	▲121.14	155.35-37	155.60-62
T/N				2W					T+1	0.243						
S/N				3W					1W	0.241						
2日				1M					2W	0.289						
3日				2M					3W	0.320						
4日				3M					1M	0.352						
5日				4M					3M	0.402						
6日				5M					6M	0.434						
有担保コール(速報)				6M					1Y	0.512						
O/N			0.180	1Y					1Y	0.512						

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1282	-	45,000	2025/1/20	2025/4/21	122,705	34,300.6	99.9090	0.3653%	75.5977%	99.9117	0.3544%	10,699	

●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)		2025/1/17	2025/1/20	▲0.050	7,722	7,722		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/17	2025/1/20	▲0.050	0	0				

●2025年1月20日の予定

* 11月の機械受注統計(市場予想:船舶、電力除く民需 前月比▲0.4%)	* NewYork祝日(Martin L. King Jr.'s Day)
* 11月の第3次産業活動指数	

◆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ことがあります。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