

Central Daily Market Report

2025年1月21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21日 需給速報	2025年1月22日 需給予想	2025年1月23日 当社予想			
銀行券	1,700	1,400	1,500			
財政	9,700	▲ 7,400	▲ 2,000			
資金過不足	11,400	▲ 6,000	▲ 500			
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		
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						300
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 4,800	4,800		4,800		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	11,400	▲ 1,200	▲ 200			
当座預金残高	5,200,700	5,199,500	5,199,300			
準備預金残高	4,698,000					
積み終了先	4,693,800			1月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,693,800			積数	22.900	
非準備預金先	502,700			1日平均	900	
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	99.44%	日数	19.35%		

●2025年1月21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、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%程度と概ね横ばい圏で推移した。ターム物については、決定会合を控え引き続き様子見となる先が多く、閑散とした状況となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.24~0.245%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>

21日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で出合いが見られた。

<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

1/21	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	売買取統計値		平均値	
O/N	0.220	0.275	0.228	1W	0.270	0.550	0.359	T+0	0.238	
T/N				2W				T+1	0.238	
S/N				3W				1W	0.276	
2日				1M				2W	0.317	
3日				2M				3W	0.350	
4日				3M				1M	0.388	
5日			0.380	4M				3M	0.420	
6日				5M				6M	0.451	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.515	
O/N			0.180	1Y				1Y	0.530	

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)
1.185	▲ 0.005	39,027.98	+125.48	155.28-30	155.67-70
日付	1/14	1/15	1/16	1/17	1/20
日銀当預残	5,211,400	5,189,100	5,183,000	5,186,100	5,189,300
準備預金残	4,701,300	4,686,300	4,674,400	4,689,800	4,690,100
マネタリーベース	6,482,000	6,457,000	6,448,600	6,449,000	6,450,600
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	122,939	125,819	126,640	127,890	127,861
うち無担	80,745	82,949	83,740	84,930	84,989
うちO/N	28,939	31,783	32,104	34,384	34,533
うち有担	42,194	42,870	42,900	42,960	42,872

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
40年利付国債	17	2.2%	7,000	2025/1/22	2064/3/20	19,249	6,995	90.90	2.570%	39.8523%				
交付税特会	-	-	13,000	2025/1/30	2025/7/31	33,385	13,000		0.570%	89.6310%		0.538%		-

●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	応募総額(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		2025/1/23	2025/1/30	4.580	3	3				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/1/21	2025/1/22	▲0.050	4,905	4,905		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2025/1/22	2025/2/5	0.250	36,115	8,006				22.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/21	2025/1/22	▲0.050	53	53		▲0.050	▲0.050	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2025/1/22	2025/1/31	0.220	4	4		0.220	0.220	

●2025年1月22日の予定

*特にありません

◆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