

Central Daily Market Report

2025年1月22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22日 需給速報	2025年1月23日 需給予想	2025年1月24日 当社予想			
銀行券	1,600	1,100	1,000			
財政	▲ 3,000	10,600	1,000			
資金過不足	▲ 1,400	11,700	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	8,000	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			10,500			
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	▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 5,600	4,800		5,600		
当預増減	▲ 2,200		27,900			2,000
当座預金残高	5,198,500		5,226,400			5,228,400
準備預金残高	4,694,400					
積み終了先	4,690,200				1月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,690,200				積数	18,600
非準備預金先	504,100				1日平均	800
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	99.54%	日数	22.58%		

●2025年1月22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、決定会合を控えて利上げを折り込んだ水準での引き合いも一部見られたが、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、0.22~0.24%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>

22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発行市場は複数の発行が観測され、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

1/22	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	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	0.219	0.275	0.228	1W	0.250	0.550	0.291				T+0	0.236	1.195	+0.010	39,646.25	+618.27	155.76-78	156.04-06	
T/N				2W							T+1	0.222							
S/N				3W															
2日				1M							1W	0.292							
3日				2M							2W	0.327							
4日				3M							3W	0.360							
5日				4M							1M	0.393							
6日				5M							3M	0.427							
有担保コール(速報)				6M							6M	0.456							
O/N			0.180	1Y							1Y	0.538							

日付	1/15	1/16	1/17	1/20	1/21
日銀当預残	5,189,100	5,183,000	5,186,100	5,189,300	5,200,700
準備預金残	4,686,300	4,674,400	4,689,800	4,690,100	4,693,800
マネタリーベース	6,457,000	6,448,600	6,449,000	6,450,600	6,460,200
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%
コール市場残高	125,819	126,640	127,890	127,861	125,905
うち無担	82,949	83,740	84,930	84,989	84,226
うちO/N	31,783	32,104	34,384	34,533	34,360
うち有担	42,870	42,900	42,960	42,872	41,679

●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	2025/1/23			10,609	3,001	0.016		0.018	17.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2025/1/23			10,299	3,002	0.018		0.020	10.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,250	2025/1/23			8,128	3,258	0.012		0.013	45.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2025/1/23			2,984	1,504	0.018		0.022	18.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/1/22	2025/1/23	▲0.050	5,758	5,758		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/22	2025/1/23	▲0.050	51	51		▲0.050	▲0.050	

●2025年1月23日の予定

* 日銀金融政策決定会合(1日目14:00~)	* 国庫短期証券(1283回)入札(3ヶ月、45,000億円、1/27発行)	* 交付税特別会計借入(12,500億円、2/4借入)
* 12月の貿易統計	* 流動性供給入札(5,000億円、1/24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