

Central Daily Market Report

2025年1月23日(木)
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23日 需給速報		2025年1月24日 需給予想		2025年1月27日 当社予想	
銀行券	1,200		1,300		1,600	
財政	20,500		2,500		▲ 5,000	
資金過不足	21,700		3,800		▲ 3,400	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,500					
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	200	▲ 200		▲ 600		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 3,500	5,600		3,500		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	34,300		6,600		▲ 3,400	
当座預金残高	5,232,800		5,239,400		5,236,000	
準備預金残高	4,733,900					
積み終了先	4,732,400				1月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,731,600				積数	16,400
非準備預金先	498,900				1日平均	700
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	99.60%	日数	25.81%		

●2025年1月23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、0.21~0.24%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＞
23日はTDB3M物(第1283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、堅調に推移した。

＜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

1/23	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	0.220	0.228	0.227	1W			0.250		T+0	0.239	1.205	+0.010	39,958.87	+312.62	156.43-45	156.60-62
T/N				2W					T+1	0.233						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.320						
3日				2M					2W	0.361						
4日				3M					3W	0.377						
5日				4M					1M	0.401						
6日				5M				3M	0.330	0.435						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.400	0.462						
O/N			0.180	1Y				1Y	0.515	0.543						

日付	1/16	1/17	1/20	1/21	1/22
日銀当預残	5,183,000	5,186,100	5,189,300	5,200,700	5,198,500
準備預金残	4,674,400	4,689,800	4,690,100	4,693,800	4,694,400
マネタリーベース	6,448,600	6,449,000	6,450,600	6,460,200	6,456,400
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%	0.228%
コール市場残高	126,640	127,890	127,861	125,905	125,744
うち無担	83,740	84,930	84,989	84,226	84,783
うちO/N	32,104	34,384	34,533	34,360	35,157
うち有担	42,900	42,960	42,872	41,679	40,961

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1283	-	45,000	2025/1/27	2025/4/28	130,636.5	34,330.7	99.9070	0.3733%	37.7310%	99.9089	0.3657%	10,669	
流動性供給	421	-	5,000	2025/1/24	-	19,288	4,991		▲0.003%	52.1904%		▲0.005%		
交付税特会	-	-	12,500	2025/2/4	2025/8/5	36,015	12,500.01		0.590%	32.5840%		0.569%		-

●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)		2025/1/23	2025/1/24	▲0.050	3,553	3,553		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/23	2025/1/24	▲0.050	2	2		▲0.050	▲0.050	

●2025年1月24日の予定

* 日銀金融政策決定会合(2日目9:00~)	* 12月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想：前年同月比(除く生鮮)+3.0%)	* 12月の米中古住宅販売件数
* 経済・物価情勢の展望		
* 日銀総裁定例会見		

◆本資料は信頼できると思わ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ものがあります。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