

Central Daily Market Report

2025年1月27日(月)

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27日 需給速報	2025年1月28日 需給予想	2025年1月29日 当社予想	
銀行券	800	1,600	1,000	
財政	12,000	▲ 5,300	5,000	
資金過不足	12,800	▲ 3,700	6,000	
金融調節	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				
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				
気候変動対応オペ				
E T F買入				
国債補完供給	▲ 45,500	5,200	45,500	
当預増減	▲ 27,500	41,800	6,000	
当座預金残高	5,206,800	5,248,600	5,254,600	
準備預金残高	4,693,800			
積み終了先	4,692,400			1月28日以降の残り所要積立額
超過準備	4,692,400			積数 10,600
非準備預金先	513,000			1日平均 600
積み期間(1/16~2/15日)の所要準備額(積数)				4,074,100
準備預金進捗率	実績 99.74%	日数 38.71%		

●2025年1月27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、引き続き邦銀業態の調達を中心とするなか、政策金利の引き上げに伴い、出合いレート水準が0.475~0.477%程度と、前営業日比で大きく上昇する展開となった。ターム物は、目立った出合いがみられず閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.03~0.35%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>

27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、大型発行を含めて複数の入札が実施された。発行レートは、追加利上げの影響から0.5%以上で推移し、銘柄によって投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

1/27	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	0.470	0.478	0.476	1W	0.476	0.540	0.482				T+0	0.090	1.215	▲ 0.015	39,565.80	▲ 366.18	155.72-75	155.86-89
T/N				2W	0.477	0.540	0.479				T+1	0.240						
S/N				3W			0.500											
2日				1M	0.530	0.680	0.555				1W	0.300						
3日				2M			0.600				2W	0.342						
4日				3M	0.585	0.620	0.608				3W	0.380						
5日				4M							1M	0.412						
6日			0.630	5M			0.630				3M	0.320						
有担保コール(速報)				6M							6M	0.350						
O/N			0.430	1Y							1Y	0.515						

日付	1/20	1/21	1/22	1/23	1/24
日銀当預残	5,189,300	5,200,700	5,198,500	5,232,800	5,234,300
準備預金残	4,690,100	4,693,800	4,694,400	4,734,600	4,725,000
マネタリーベース	6,450,600	6,460,200	6,456,400	6,489,600	6,489,700
無担O/N加重平均	0.227%	0.228%	0.228%	0.227%	0.227%
コール市場残高	127,861	125,905	125,744	122,778	123,909
うち無担	84,989	84,226	84,783	81,775	83,681
うちO/N	34,533	34,360	35,157	33,219	36,415
うち有担	42,872	41,679	40,961	41,003	40,228

●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)
流動性供給	422	-	6,500	2025/1/28	-	24,412	6,492		▲0.020%	12.4260%		▲0.023%		

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/1/27	2025/1/28	0.150	47,489	47,489		0.150	0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/27	2025/1/28	0.150	100	100		0.150	0.150	

●2025年1月28日の予定

* 12月の企業向けサービス価格指数	* 米FOMC(1日目)
	* 12月の米耐久財新規受注
	* 11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

◆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