

Central Daily Market Report

2025年1月30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30日 需給速報		2025年1月31日 需給予想		2025年2月3日 当社予想	
銀行券	900		1,400		1,000	
財政	▲ 2,000		5,300		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 1,100		6,700		▲ 25,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			4,400			
CP等買入			2,000	▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ	69,700	▲ 47,300				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 7,100	10,600		7,100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	24,700		19,500		▲ 25,000	
当座預金残高	5,271,100		5,290,600		5,265,600	
準備預金残高	4,755,400					
積み終了先	4,754,700		1月31日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,754,700		積数 8,600			
非準備預金先	515,700		1日平均 500			
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 99.79%		日数		48.39%	

●2025年1月30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からの資金調達ニーズが強く、0.475～0.477%程度での出会いとなった。ターム物は特段の出会い無く閑散であった。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.13～0.30%程度での出会いとなった。
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＞
30日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、大型発行を含めて複数の発行が実施された。発行レートは0.5%以上で推移し、銘柄により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

1/30	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	0.470	0.478	0.477	1W	0.481	0.550	0.507		T+0	0.293	1.210	+0.02	39,513.97	+99.19	155.17-21	154.53-55
T/N				2W					T+1	0.147						
S/N				3W												
2日				1M			0.570		1W	0.276						
3日				2M			0.580		2W	0.343						
4日				3M			0.585		3W	0.382						
5日				4M					1M	0.403						
6日				5M				3M	0.320	3M	0.436					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.345	6M	0.472					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.530	1Y	0.550					
日付																
日銀当預残		1/23	1/24	1/27	1/28	1/29										
準備預金残		5,232,800	5,234,300	5,206,800	5,222,800	5,246,400										
マネタリーベース		4,734,600	4,725,000	4,692,100	4,714,700	4,743,800										
無担O/N加重平均		6,489,600	6,489,700	6,461,400	6,475,600	6,498,700										
コール市場残高		0.227%	0.227%	0.476%	0.477%	0.477%										
うち無担		122,778	123,909	118,942	119,160	121,220										
うちO/N		81,775	83,681	79,248	79,026	80,441										
うち有担		33,219	36,415	35,172	34,880	32,815										
		41,003	40,228	39,694	40,134	40,779										

●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Ⅰ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5年超10年以下)	3,250	2025/1/31			6,998	3,255	0.020		0.021	89.9
国債買入(残存期間25年超)	750	2025/1/31			2,555	753	0.031		0.031	94.1
国債買入(物価連動債)	500	2025/1/31			2,039	500	▲0.350		▲0.396	40.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/1/30	2025/1/31	0.050	7,273	7,273		0.050	0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/30	2025/1/31	0.050	0	0				

●2025年1月31日の予定

* 1月の都区部消費者物価指数	* 12月の米個人所得・消費支出(PCE)	* 国庫短期証券(1284回)入札(3ヶ月、45,000億円、2/3発行)
* 12月の労働力調査	* 1月のシカゴPM景況感指数	* 2年利付国債入札(26,000億円、2/3発行)
* 12月の一般職業紹介状況		
* 12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報		
* 12月の商業動態統計速報		
* 12月の住宅着工統計		
◆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論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		