

# Central Daily Market Report

2025年1月28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28日 需給速報	2025年1月29日 需給予想	2025年1月30日 当社予想			
銀行券	1,700	500	2,000			
財政	▲ 5,600	▲ 2,500	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 3,900	▲ 2,000	▲ 3,000			
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		7,400				
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						▲ 47,300
E T F買入						
国債補完供給	▲ 25,600	45,500	25,600			
当預増減	16,000	31,000	▲ 50,300			
当座預金残高	5,222,800	5,253,800	5,203,500			
準備預金残高	4,714,700					
積み終了先	4,714,300			1月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,713,900			積数	9,800	
非準備預金先	508,100			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	99.76%	日数	41.94%		

## ●2025年1月28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。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.05~0.18%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>

28日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <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。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り2,000億円でおfferされた。結果は、按分レート0.54%、平均落札レート0.58%と、前回(按分0.457%、平均0.534%)比で按分、平均ともに上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

1/28	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		0.550			T+0	0.056	1.190	▲ 0.025	39,016.87	▲ 548.93	154.90-92	155.84-87	
T/N				2W	0.525	0.540	0.532		T+1	0.073							
S/N				3W			0.580										
2日				1M	0.540	0.650	0.568		1W	0.198							
3日				2M			0.565		2W	0.286							
4日				3M			0.580		3W	0.339							
5日				4M					1M	0.380							
6日				5M				3M	0.320	3M	0.428						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.345	6M	0.468						
O/N			0.430	1Y				1Y	0.515	1Y	0.550						

日付	1/21	1/22	1/23	1/24	1/27
日銀当預残	5,200,700	5,198,500	5,232,800	5,234,300	5,206,800
準備預金残	4,693,800	4,694,400	4,734,600	4,725,000	4,692,100
マネタリーベース	6,460,200	6,456,400	6,489,600	6,489,700	6,461,400
無担O/N加重平均	0.228%	0.228%	0.227%	0.227%	0.476%
コール市場残高	125,905	125,744	122,778	123,909	118,942
うち無担	84,226	84,783	81,775	83,681	79,248
うちO/N	34,360	35,157	33,219	36,415	35,172
うち有担	41,679	40,961	41,003	40,228	39,694

## ●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	2025/1/29			8,190	3,007	▲0.017		▲0.014	21.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2025/1/29			10,367	3,010	▲0.017		▲0.016	49.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2025/1/29			2,907	1,502	▲0.013		▲0.001	57.8
米ドル資金供給		2025/1/30	2025/2/6	4.580	2	2				
CP等買入	2,000	2025/1/31			6,167	1,992	0.540		0.580	81.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/1/28	2025/1/29	▲0.050	26,318	26,318		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/28	2025/1/29	▲0.050	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2025/1/29	2025/2/7	0.470	4	4		0.470	0.470	

## ●2025年1月29日の予定

* 金融政策決定会合要旨(12月18・19日分)	* 米FOMC(2日目)	* GX5年利付国債入札(3,500億円、1/30発行)
	* 1月の米CB消費者信頼感指数	* 交付税特別会計借入(12,500億円、2/7借入)

◆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