

Central Daily Market Report

2025年1月31日(金)

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31日 需給速報	2025年2月3日 需給予想	2025年2月4日 当社予想			
銀行券	1,400	1,000	500			
財政	4,300	▲ 17,500	▲ 65,000			
資金過不足	5,700	▲ 16,500	▲ 64,500			
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 5,100	7,100	5,100			
*ドル資金供給用国債補完供給						
当増減	13,400	▲ 11,400	▲ 64,500			
当座預金残高	5,284,500	5,273,100	5,208,600			
準備預金残高	4,744,500					
積み終了先	4,743,700			2月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,743,700			積数	6,400	
非準備預金先	540,000			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	99.84%	日数	58.06%		

●2025年1月31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資金調達ニーズが強く、出合いの水準は0.475~0.477%程度で推移した。月末要因により一部で調達を控える動きも見られたものの、相場への影響は限定的であった。ターム物は目立った出合い無く、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.355~0.485%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>

31日はTDB3M物(第1284回)の入札が実施され、しっかりとした結果となり、その後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は数件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

1/31	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	0.430	0.525	0.477	1W	0.640	0.650	0.643	T+0	0.169	1.240	+0.03	39,572.49	+58.52	154.09-11	154.65-66	
T/N				2W				T+1	0.404							
S/N				3W				1W	0.373							
2日				1M				2W	0.386							
3日				2M				3W	0.400							
4日			0.630	3M		0.580		1M	0.422							
5日				4M				3M	0.439							
6日				5M				6M	0.472							
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.530							
O/N			0.430	1Y				1Y	0.550							

日付	1/24	1/27	1/28	1/29	1/30
日銀当預残	5,234,300	5,206,800	5,222,800	5,246,400	5,271,100
準備預金残	4,725,000	4,692,100	4,714,700	4,743,800	4,755,600
マネタリーベース	6,489,700	6,461,400	6,475,600	6,498,700	6,522,500
無担O/N加重平均	0.227%	0.476%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	123,909	118,942	119,160	121,220	126,448
うち無担	83,681	79,248	79,026	80,441	84,972
うちO/N	36,415	35,172	34,880	32,815	35,816
うち有担	40,228	39,694	40,134	40,779	41,476

●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I非償格競争入札(億円)	非償競争入札(億円)
国庫短期証券	1284	-	45,000	2025/2/3	2025/5/7	124,676.5	34,266.8	99.9135	0.3397%	44.7138%	99.9173	0.3248%	10,733	
2年利付国債	469	0.7%	26,000	2025/2/3	2027/2/1	79,762	19,644	99.940	0.730%	48.1939%	99.946	0.727%	6,346	3.1

●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)		2025/1/31	2025/2/3	▲0.150	5,320	5,320		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/1/31	2025/2/3	▲0.150	0	0				

●2025年2月3日の予定

* 決定会合における主な意見(1月23・24日分)	* 1月のISM製造業景況指数 * 12月の米建設支出 * 1月のユーロ圏消費者物価指数速報値
---------------------------	---

◆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