

Central Daily Market Report

2025年2月6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2月6日 需給速報		2025年2月7日 需給予想		2025年2月10日 当社予想	
銀行券	800		800		1,000	
財政	6,400		▲ 5,800		3,000	
資金過不足	7,200		▲ 5,000		4,000	
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						
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				▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 3,700	5,000		3,700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	8,500		▲ 1,500		4,000	
当座預金残高	5,179,400		5,177,900		5,181,900	
準備預金残高	4,674,400					
積み終了先	4,674,000		2月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,674,000		積数 3,300			
非準備預金先	505,000		1日平均 400			
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 99.92%		日数 70.97%			

●2025年2月6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、0.35~0.435%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＞
6日は、TDB6M物(第1285回)の入札が実施され、強めの結果となり、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、一部大型発行も見られた。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

2/6	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	0.450	0.525	0.479	1W			0.525		T+0	0.482	1.260	▲ 0.020	39,066.53	+235.05	152.64-66	152.57-59
T/N				2W	0.535	0.550	0.543		T+1	0.410						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.426						
3日				2M			0.620		2W	0.429						
4日				3M					3W	0.430						
5日				4M					1M	0.433						
6日			0.630	5M				3M	0.315	3M	0.448					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.330	6M	0.480					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.540	1Y	0.551					
日付																
1/30																
1/31																
2/3																
2/4																
2/5																
日銀当預残																
5,271,100																
準備預金残																
4,755,600																
マネタリーベース																
6,522,500																
無担O/N加重平均																
0.477%																
コール市場残高																
126,448																
うち無担																
84,972																
うちO/N																
35,816																
うち有担																
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1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1285	-	35,000	2025/2/10	2025/8/12	101,865	26,930.9	99.812	0.3756%	86.7769%	99.814	0.3716%	8,069	
30年利付国債	85	2.3%	9,000	2025/2/7	2054/12/20	25,286	6,757	100.10	2.294%	93.1057%	100.17	2.290%	2,239	
エネルギー対策	-	-	4,423	2025/2/20	2026/2/20	19,276	4,423		0.710%	93.0500%		0.684%		

●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)		2025/2/6	2025/2/7	0.150	3,901	3,901		0.150	0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/2/6	2025/2/7	0.150	0	0				

●2025年2月7日の予定

*1月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *12月の全世帯家計調査 *12月の特定サービス産業動態統計速報 *12月の景気動向指数速報	*1月の米雇用統計 *12月の米卸売売上高 *2月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *12月の米消費者信用残高	*国庫短期証券(1286回)入札 (3ヶ月、45,000億円、2/10発行)
--	--	---

◆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