

Central Daily Market Report

2025年2月13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13日 需給速報	2025年2月14日 需給予想	2025年2月17日 当社予想			
銀行券	600	500	▲ 500			
財政	12,500	82,000	▲ 25,000			
資金過不足	13,100	82,500	▲ 25,500			
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		7,800				
CP等買入			▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						▲ 300
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 2,900	4,800	2,900			
当預増減	15,000	93,100	▲ 25,800			
当座預金残高	5,208,900	5,302,000	5,276,200			
準備預金残高	4,702,400					
積み終了先	4,702,100			2月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,702,100			積数	700	
非準備預金先	506,500			1日平均	300	
積み期間(1/16~2/15日)の所要準備額(積数)					4,082,300	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	93.55%		

●2025年2月13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。試し取りが行われたが、規模は小さく、加重平均レートは前営業日対比で低下した。ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.25~0.37%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>

13日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。発行レートは0.5%以上で推し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

2/13	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	0.477	1W						T+0	0.384	1.350	+0.010	39,461.47	+497.77	154.22-24	154.27-29	
T/N				2W		0.550				T+1	0.351							
S/N				3W														
2日				1M		0.540				1W	0.411							
3日				2M						2W	0.419							
4日				3M						3W	0.422							
5日				4M						1M	0.427							
6日				5M						3M	0.449							
有担保コール(速報)				6M						6M	0.482							
O/N			0.430	1Y						1Y	0.552							

日付	2/5	2/6	2/7	2/10	2/12
日銀当預残	5,170,900	5,179,400	5,176,700	5,194,600	5,193,900
準備預金残	4,669,400	4,674,700	4,665,600	4,685,200	4,688,500
マネタリーベース	6,417,700	6,425,400	6,421,700	6,438,700	6,437,400
無担O/N加重平均	0.479%	0.479%	0.477%	0.477%	0.485%
コール市場残高	123,800	124,725	121,730	122,797	126,519
うち無担	84,229	86,088	83,028	82,955	88,072
うちO/N	36,810	38,099	35,649	36,006	42,803
うち有担	39,571	38,637	38,702	39,842	38,447

●オペ結果

種類	オフー額 (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)	着札総額 (億円・ 百万ドル)	差分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均着札レート ・利回較差 ・価格較差	差分 比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2025/2/14			10,112	3,001	0.003		0.004	79.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,250	2025/2/14			4,788	3,255	0.020		0.024	4.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2025/2/14			3,389	1,503	0.027		0.030	98.9
国債買入(残存期間25年超)	750	2025/2/14			2,110	750	0.018		0.024	20.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)		2025/2/13	2025/2/14	0.150	3,096	3,096		0.150	0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)		2025/2/13	2025/2/14	0.150	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)	
被災地金融支援オペ	第27回	2025/2/17	2026/2/16	0.50%	0

●2025年2月14日の予定

*1月の米小売売上高	*国庫短期証券(1287回)入札 (3ヶ月、45,000億円、2/17発行)	*国有林野特別会計借入 (960億円、2/25借入)
*1月の米鉱工業生産・設備稼働率		
*12月の米企業在庫	*5年利付国債入札 (23,000億円、2/17発行)	
*10-12月期のユーロ圏GDP2次速報		

◆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