

Central Daily Market Report

2025年2月18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2月18日 需給速報	2025年2月19日 需給予想	2025年2月20日 当社予想
銀行券	1,000	▲ 100	1,000
財政	▲ 6,900	▲ 4,000	15,000
資金過不足	▲ 5,900	▲ 4,100	16,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		8,000	▲ 8,000
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			
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 3,300	2,600	3,300
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	▲ 6,600	▲ 800	16,000
当座預金残高	5,270,300	5,269,500	5,285,500
準備預金残高	4,762,900		
積み終了先	4,747,700		2月19日以降の残り所要積立額
超過準備	4,721,300		積数 46,200
非準備預金先	507,400		1日平均 1,800
積み期間（2/16～3/15日）の所要準備額（積数）			3,681,900
準備預金進捗率	実績	98.75%	日数 10.71%

●2025年2月18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、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、0.455～0.485%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＞
18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、複数の業態で大型発行が実施された。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

2/18	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			0.550		T+0	0.459	1.430	+0.045	39,270.40	+96.15	151.43-45	152.05-06
T/N				2W			0.550		T+1	0.448						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.421						
3日				2M					2W	0.423						
4日				3M					3W	0.421						
5日				4M					1M	0.423						
6日			0.630	5M				3M	0.295	3M	0.449					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.340	6M	0.486					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.600	1Y	0.554					
日付																
2/10																
2/12																
2/13																
2/14																
2/17																
日銀当預残																
5,194,600																
準備預金残																
4,685,200																
マネタリーベース																
6,438,700																
無担O/N加重平均																
0.477%																
コール市場残高																
122,797																
うち無担																
82,955																
うちO/N																
36,006																
うち有担																
39,842																

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
20年利付国債	191	2.0%	10,000	2025/2/19	2044/12/20	23,312	7,629	99.05	2.067%	9.1954%	99.60	2.028%	2,365	

●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
米ドル資金供給		2025/2/20	2025/2/27	4.580	2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/2/18	2025/2/19	0.150	3,473	3,473		0.150	0.149	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2025/2/19	2025/3/5	0.500	13,673	8,009				58.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/2/18	2025/2/19	0.150	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2025/2/19	2025/2/28	0.470	2	2		0.470	0.470	

●2025年2月19日の予定

*12月の機械受注統計 *12月の石油等消費動態統計	*1月の米住宅着工件数 *1月の英消費者物価指数	*国庫短期証券(1288回)入札 (1年、32,000億円、2/20発行) *交付税特別会計借入 (12,500億円、2/28借入)
-------------------------------	-----------------------------	---

◆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