

Central Daily Market Report

2025年2月26日(水)
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26日 需給速報		2025年2月27日 需給予想		2025年2月28日 当社予想	
銀行券	300		▲ 400		500	
財政	▲ 7,200		1,900		7,600	
資金過不足	▲ 6,900		1,500		8,100	
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			8,200			
CP等買入				▲ 100		
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	▲ 5,000	4,500		5,000		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 7,400		14,600		8,100	
当座預金残高	5,311,300		5,325,900		5,334,000	
準備預金残高	4,835,600					
積み終了先	4,834,600				2月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,834,400				積数 5,100	
非準備預金先	475,700				1日平均 300	
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 99.86%		日数 39.29%			

●2025年2月26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、0.475~0.49%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＞
26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市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。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。

●2025年2月27日の予定

*10-12月期の米GDP改定値
*1月の米耐久財新規受注
*2年利付国債入札
(26,000億円、3/3発行)

●短期金融市場関連指標

2/26	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	0.500	0.550	0.527		T+0	0.476	1.365	▲ 0.015	38,142.37	▲ 95.42	149.05-07	149.53-54
T/N				2W					T+1	0.474						
S/N				3W			0.550									
2日				1M	0.529	0.600	0.543		1W	0.444						
3日				2M					2W	0.442						
4日				3M			0.585		3W	0.439						
5日				4M					1M	0.435						
6日				5M				3M	0.300	3M	0.456					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.330	6M	0.492					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.600	1Y	0.580					

日付	2/18	2/19	2/20	2/21	2/25
日銀当預残	5,270,300	5,269,400	5,307,300	5,295,700	5,318,700
準備預金残	4,762,900	4,792,100	4,825,800	4,822,300	4,847,700
マネタリーベース	6,511,300	6,510,500	6,547,900	6,536,300	6,559,600
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.478%	0.479%
コール市場残高	120,379	118,632	117,568	118,701	122,758
うち無担	82,915	80,840	80,758	81,804	84,955
うちO/N	36,996	35,541	35,269	36,345	36,651
うち有担	37,464	37,792	36,810	36,897	37,803

●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)
交付税特会	-	-	11,950	2025/3/11	2025/9/10	33,377	11,950		0.6100%	18.2500%		0.6010%		-

●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3年超5年以下)	3,000	2025/2/27			12,627	3,005	▲0.029		▲0.027	15.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,250	2025/2/27			9,005	3,256	▲0.038		▲0.037	75.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2025/2/27			2,615	1,501	▲0.048		▲0.042	100.0
国債買入(物価連動債)	500	2025/2/27			1,964	500	▲0.160		▲0.220	4.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/2/26	2025/2/27	0.250	5,183	5,183		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/2/26	2025/2/27	0.250	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・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特則第39期(借り換え)	2025/3/4	2026/3/4	830	8

◆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