

Central Daily Market Report

2025年2月28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2月28日 需給速報		2025年3月3日 需給予想		2025年3月4日 当社予想	
銀行券	400		500		500	
財政	800		▲ 36,700		▲ 50,000	
資金過不足	1,200		▲ 36,200		▲ 49,500	
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						
CP等買入		▲ 500				
貸出支援基金（成）				▲ 6,700		
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	▲ 12,900	6,300		12,900		
※ドル資金供給用国債提供給						
当預増減	▲ 6,100		▲ 30,000		▲ 49,500	
当座預金残高	5,312,600		5,282,600		5,233,100	
準備預金残高	4,814,600		3月3日以降の残り所要積立額 積数 1,600 1日平均 100			
積み終了先	4,813,800					
超過準備	4,813,800					
非準備預金先	498,000					
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 99.96%		日数 53.57%			

●2025年2月28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为中心であった。月末を挟む取引となり、ビッドニーズが減退する先も見られたが、0.475～0.478%程度と、一部小高い水準での出会いも見られた。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。

＜レボ市場＞
GC T/Nは、0.45～0.475%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＞
28日はTDB3M物（第1290回）の入札が実施され、ややテールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小甘く推移した。

＜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

2/28	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	0.479	0.477	1W					T+0	0.401	1.370	▲ 0.020	37,155.50	▲ 1,100.67	150.07-10	150.43-45
T/N				2W	0.640	0.650	0.645		T+1	0.465						
S/N				3W												
2日				1M			0.600		1W	0.441						
3日				2M					2W	0.439						
4日			0.630	3M	0.620	0.700	0.640		3W	0.435						
5日				4M					1M	0.432						
6日				5M				3M	0.330	3M	0.458					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.360	6M	0.494					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.600	1Y	0.588					
日付																
2/20 2/21 2/25 2/26 2/27																
日銀当預残 5,307,300 5,295,700 5,318,700 5,311,300 5,318,700																
準備預金残 4,825,800 4,822,300 4,847,700 4,835,900 4,842,900																
マネタリーベース 6,547,900 6,536,300 6,559,600 6,551,800 6,559,500																
無担O/N加重平均 0.477% 0.478% 0.479% 0.477% 0.477%																
コール市場残高 117,568 118,701 122,758 120,763 123,947																
うち無担 80,758 81,804 84,955 82,486 86,301																
うちO/N 35,269 36,345 36,651 33,912 37,097																
うち有担 36,810 36,897 37,803 38,277 37,646																

●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）
国庫短期証券	1290	-	45,000	2025/3/3	2025/6/2	94,194.1	34,558.8	99.9145	0.3432%	7.7154%	99.9189	0.3255%	10,441	

●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）		2025/2/28	2025/3/3	0.150	12,532	12,434		0.150	0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2025/2/28	2025/3/3	0.150	1,460	1,460		0.150	0.141	

●2025年3月3日の予定

*2月のISM製造業景況指数
*1月の米建設支出
*2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