

Central Daily Market Report

2025年3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3月6日 需給速報		2025年3月7日 需給予想		2025年3月10日 当社予想	
銀行券	400		1,000		1,500	
財政	▲ 3,600		▲ 1,700		12,000	
資金過不足	▲ 3,200		▲ 700		13,500	
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	8,600					
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 3,300	3,800		3,300		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	5,500		2,000		13,500	
当座預金残高	5,204,100		5,206,100		5,219,600	
準備預金残高	4,752,200					
積み終了先	4,752,200				3月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,752,200				積数 300	
非準備預金先	451,900				1日平均 0	
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 99.99%		日数		67.86%	

●2025年3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、0.475~0.478%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期内物で引き合いが散見された。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.45~0.495%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1291回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりで推移した。

＜CP市場＞
CP発行市場は複数の業態で入札が実施され、一部で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

3/6	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	0.478	0.476	1W	0.530	0.550	0.533		T+0	0.490	1.515	+0.075	37,704.93	+286.69	148.87-89	148.36-38
T/N				2W					T+1	0.462						
S/N				3W												
2日				1M			0.670		1W	0.447						
3日				2M					2W	0.442						
4日				3M	0.605	0.620	0.608		3W	0.441						
5日				4M					1M	0.436						
6日			0.630	5M				3M	0.345	3M	0.456					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.430	6M	0.497					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.610	1Y	0.595					
日付																
2/27																
2/28																
3/3																
3/4																
3/5																
日銀当預残																
5,318,700																
5,312,600																
5,276,300																
5,229,500																
5,198,600																
準備預金残																
4,842,900																
4,814,400																
4,797,800																
4,757,200																
4,740,400																
マネタリーベース																
6,559,500																
6,553,000																
6,516,200																
6,468,300																
6,437,200																
無担O/N加重平均																
0.477%																
0.477%																
0.477%																
0.476%																
0.476%																
コール市場残高																
123,947																
129,625																
131,083																
121,159																
122,544																
うち無担																
86,301																
91,984																
93,659																
85,194																
86,409																
うちO/N																
37,097																
42,150																
43,335																
33,890																
34,350																
うち有担																
37,646																
37,641																
37,424																
35,965																
36,135																

●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	1291	-	35,000	2025/3/10	2025/9/10	80,124	26,667	99.772	0.4533%	25.0000%	99.780	0.4373%	8,333	
30年利付国債	85	2.3%	9,000	2025/3/7	2054/12/20	23,651	6,758	96.45	2.508%	92.5925%	96.57	2.500%	2,239	

●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)		2025/3/6	2025/3/7	0.250	3,492	3,492		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/3/6	2025/3/7	0.250	0	0				