

Central Daily Market Report

2025年3月10日(月)  
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10日<br>需給速報 |       | 2025年3月11日<br>需給予想                  |       | 2025年3月12日<br>当社予想 |           |
|----------------------------|--------------------|-------|-------------------------------------|-------|--------------------|-----------|
| 銀行券                        | 500                |       | 700                                 |       | 1,000              |           |
| 財政                         | 7,900              |       | ▲ 23,400                            |       | 1,000              |           |
| 資金過不足                      | 8,400              |       | ▲ 22,700                            |       | 2,000              |           |
| 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                      |                    | ▲ 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                     | ▲ 5,900            | 4,900 |                                     | 5,900 |                    |           |
| ※ドル資金供給用信託国債供給             |                    |       |                                     |       |                    |           |
| 当預増減                       | 7,300              |       | ▲ 16,800                            |       | 2,000              |           |
| 当座預金残高                     | 5,202,900          |       | 5,186,100                           |       | 5,188,100          |           |
| 準備預金残高                     | 4,705,700          |       | 3月11日以降の残り所要積立額<br>積数 100<br>1日平均 0 |       |                    |           |
| 積み終了先                      | 4,705,600          |       |                                     |       |                    |           |
| 超過準備                       | 4,705,600          |       |                                     |       |                    |           |
| 非準備預金先                     | 497,200            |       |                                     |       |                    |           |
| 積み期間（2/16～3/15日）の所要準備額（積数） |                    |       |                                     |       |                    | 3,669,000 |
| 準備預金進捗率                    | 実績 100.00%         |       | 日数                                  |       | 82.14%             |           |

●2025年3月10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、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られており、出合いの水準は0.475~0.478%程度と横ばい圏で推移した。ターム物はショートターム物を中心に引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.46~0.49%程度での出合いとなった。  
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＞

10日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

＜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

| 3/10       | 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 | 0.478 | 1W | 0.478 | 0.650 | 0.495 |         | T+0     | 0.481 | 1.574     | +0.054 | 37,028.27 | +141.10 | 147.57-59 | 147.58-60 |
| T/N        |            |       |       | 2W |       |       | 0.550 |         | T+1     | 0.485 |           |        |           |         |           |           |
| S/N        |            |       |       | 3W |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 2日         |            |       |       | 1M |       |       | 0.570 |         | 1W      | 0.451 |           |        |           |         |           |           |
| 3日         |            |       |       | 2M |       |       |       |         | 2W      | 0.445 |           |        |           |         |           |           |
| 4日         |            |       |       | 3M |       |       |       |         | 3W      | 0.441 |           |        |           |         |           |           |
| 5日         |            |       |       | 4M |       |       |       |         | 1M      | 0.436 |           |        |           |         |           |           |
| 6日         |            |       |       | 5M |       |       |       | 3M      | 0.280   | 3M    | 0.458     |        |           |         |           |           |
| 有担保コール(速報) |            |       |       | 6M |       |       |       | 6M      | 0.415   | 6M    | 0.497     |        |           |         |           |           |
| O/N        |            |       | 0.430 | 1Y |       |       |       | 1Y      | 0.599   | 1Y    | 0.599     |        |           |         |           |           |
| 日付         |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 3/3        |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 3/4        |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 3/5        |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 3/6        |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 3/7        |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 日銀当預残      |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 5,276,300  |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 準備預金残      |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 4,797,800  |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| マネタリーベース   |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 6,516,200  |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 無担O/N加重平均  |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 0.477%     |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| コール市場残高    |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 131,083    |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| うち無担       |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 93,659     |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| うちO/N      |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 43,335     |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| うち有担       |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |
| 37,424     |            |       |       |    |       |       |       |         |         |       |           |        |           |         |           |           |

●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) |
|--------|-----|------|--------|-----------|------------|---------|---------|-------|-------------|----------|--------|-------------|---------------|-----------|
| 5年利付国債 | 177 | 1.1% | 23,000 | 2025/3/11 | 2029/12/20 | 55,439  | 17,512  | 99.67 | 1.172%      | 46.9172% | 99.74  | 1.157%      | 5,482         | —         |

●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) |                | 2025/3/10 | 2025/3/11 | 0.250 | 6,298         | 6,298         |                 | 0.250           | 0.250             |      |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) |                | 2025/3/10 | 2025/3/11 | 0.250 | 0             | 0             |                 |                 |                   |      |

●2025年3月11日の予定

|                                                    |                                 |
|----------------------------------------------------|---------------------------------|
| * 1月の全世帯家計調査<br>* 10-12月期のGDP 2次速報<br>* 2月のマネーストック | * エネルギー対策特別会計借入(7,438億円、3/21借入) |
|----------------------------------------------------|---------------------------------|

|                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ◆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。<br>◆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。<br>◆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。<br>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 |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|