

Central Daily Market Report

2025年3月13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13日 需給速報	2025年3月14日 需給予想	2025年3月17日 当社予想		
銀行券	400	300	2,000		
財政	▲ 7,600	9,400	▲ 9,500		
資金過不足	▲ 7,200	9,700	▲ 7,500		
金融調節	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)				▲ 64,500	
被災地支援					
社債等買入			▲ 100		
気候変動対応オペ					
E T F 買入					
国債補完供給	▲ 3,400	5,300	3,400		
当預増減	▲ 5,300	12,900	▲ 72,000		
当座預金残高	5,178,000	5,190,900	5,118,900		
準備預金残高	4,695,200				
積み終了先	4,695,100			3月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,695,100			積数	0
非準備預金先	482,800			1日平均	0
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	92.86%	

●2025年3月13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、出会いの水準は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、0.465~0.49%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>

13日のアウトライ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発行市場は複数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

3/13	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値		平均値	
O/N	0.450	0.478	0.476	1W	0.530	0.560	0.535	T+0	0.493	
T/N				2W	0.530	0.550	0.540	T+1	0.478	
S/N				3W				1W	0.449	
2日				1M				2W	0.444	
3日				2M				3W	0.438	
4日				3M				1M	0.436	
5日				4M				3M	0.457	
6日				5M				6M	0.498	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.601	
O/N			0.430	1Y						

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	終値	前日比	為替(9時)	為替(17時)
1.545	+0.025	36,790.03	▲ 29.06	148.28-30	147.81-82
日付	3/6	3/7	3/10	3/11	3/12
日銀当預残	5,204,100	5,195,600	5,202,900	5,181,100	5,183,300
準備預金残	4,753,500	4,718,000	4,705,700	4,701,900	4,692,900
マネタリーベース	6,442,300	6,432,700	6,439,400	6,416,800	6,418,600
無担O/N加重平均	0.476%	0.477%	0.478%	0.479%	0.479%
コール市場残高	122,673	121,345	122,458	122,040	123,447
うち無担	87,741	84,565	86,137	86,260	87,677
うちO/N	35,682	34,086	35,238	35,891	37,903
うち有担	34,932	36,780	36,321	35,780	35,770

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)		2025/3/13	2025/3/14	0.250	3,566	3,566		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/3/13	2025/3/14	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)	
貸出増加支援オペ	貸付期間1年	2025/3/17	2026/3/16	変動※	18,695

※貸付期間中の補完当座預金制度の適用利率の平均値。

●2025年3月14日の予定

* 3月のミシガン大消費者信頼感指数速報	* 国庫短期証券(1293回)入札(3ヶ月、45,000億円、3/17発行)	* 流動性供給入札(5,000億円、3/17発行)
----------------------	--	---------------------------

◆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必要があります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録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