

Central Daily Market Report

2025年3月18日（火）
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18日 需給速報		2025年3月19日 需給予想		2025年3月21日 当社予想	
銀行券	400		▲ 300		▲ 500	
財政	▲ 900		3,000		68,000	
資金過不足	▲ 500		2,700		67,500	
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			8,000	▲ 8,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,300					
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				▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 4,000	4,100		4,000		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	9,900		6,400		67,500	
当座預金残高	5,147,400		5,153,800		5,221,300	
準備預金残高	4,669,600					
積み終了先	4,625,300				3月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,572,900				積数 69,700	
非準備預金先	477,800				1日平均 2,500	
積み期間（3/16～4/15日）の所要準備額（積数）						4,121,700
準備預金進捗率	実績	98.31%	日数	9.68%		

●2025年3月18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、昨日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、出合いの水準は0.475～0.477%程度と横ばい圏で推移した。
ターム物は期内物での引き合いが散見された。

＜レボ市場＞

GC T/Nは、0.48～0.505%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＞

18日はTDB1Y物（第1294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、堅調に推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施され、一部の業態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

3/18	無担保コール（速報）							短国	東京レボレート		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	0.478	0.530	0.498		T+0	0.496	1.500	▲ 0.005	37,845.42	+448.90	149.38-40	149.83-84
T/N			0.630	2W					T+1	0.489						
S/N				3W												
2日				1M			0.555		1W	0.453						
3日				2M					2W	0.435						
4日				3M					3W	0.436						
5日				4M					1M	0.435						
6日				5M				3M	0.300	3M	0.458					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.445	6M	0.502					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.615	1Y	0.603					
日付																
		3/11	3/12	3/13	3/14	3/17										
日銀当預残		5,181,100	5,183,300	5,178,000	5,187,200	5,137,500										
準備預金残		4,701,900	4,692,900	4,695,300	4,700,400	4,656,400										
マネタリーベース		6,416,800	6,418,600	6,412,800	6,421,700	6,371,800										
無担O/N加重平均		0.479%	0.479%	0.476%	0.477%	0.477%										
コール市場残高		122,040	123,447	121,268	121,783	120,588										
うち無担		86,260	87,677	84,065	86,181	85,743										
うちO/N		35,891	37,903	34,831	37,722	37,734										
うち有担		35,780	35,770	37,203	35,602	34,845										

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1294	-	32,000	2025/3/21	2026/3/23	90,191	24,278.7	99.373	0.6275%	78.7425%	99.382	0.6184%	7,721

●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
米ドル資金供給		2025/3/21	2025/3/27	4.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/3/18	2025/3/19	0.250	4,309	4,309		0.250	0.250	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2025/3/19	2025/4/2	0.500	18,777	8,012				42.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/3/18	2025/3/19	0.250	70	70		0.250	0.250	

●2025年3月19日の予定

* 日銀金融政策決定会合(2日目)	* 2月の貿易統計	* 米FOMC(2日目)
* 日銀総裁定例会見	* 1月の機械受注統計	* FRB 米経済見通し発表
	* 1月の石油等消費動態統計	* 2月のユーロ圏消費者物価指数改定値

◆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