Central Daily Market Report

2025年3月25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25日 需給速報	2025年3月26日 需給予想	2025年3月27日 当社予想		
銀行券	200	▲ 300	▲ 500		
財政	39,500	▲ 700	5,000		
資金過不足	39,700	▲ 1,000	4,500		
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	9,700				
CP等買入					
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	▲ 4,100	4,000	4,100		
当預増減	49,300	3,100	4,500		
当座預金残高	5,267,300	5,270,400	5,274,900		
準備預金残高	4,783,800				
積み終了先	4,782,200			3月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,780,900			積数	11,000
非準備預金先	483,500			1日平均	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	99.73%	日数	32.26%	

●2025年3月25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、3月末越えの資金に目途が付き始めた先も多く、調整程度の動きが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.485~0.49%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>

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で少額の出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で発行が実施された。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

3/25	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	0.600	0.620	0.610	T+0	0.482	1.574	+0.034	37,780.54	+172.05	150.79~80	150.72~73	
T/N				2W			0.481	T+1	0.489							
S/N				3W				1W	0.455							
2日				1M				2W	0.450							
3日				2M				3W	0.446							
4日				3M				1M	0.444							
5日				4M				3M	0.461							
6日				5M				6M	0.400							
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.610							
O/N			0.430	1Y				1Y	0.604							

日付	3/17	3/18	3/19	3/21	3/24
日銀当預残	5,137,500	5,147,400	5,153,200	5,222,300	5,218,000
準備預金残	4,656,400	4,672,300	4,681,100	4,737,000	4,735,300
マネタリーベース	6,371,800	6,381,300	6,387,500	6,456,900	6,452,700
無担O/N加重平均	0.477%	0.476%	0.477%	0.477%	0.476%
コール市場残高	120,588	120,535	118,789	123,521	120,562
うち無担	85,743	85,283	83,342	87,129	84,555
うちO/N	37,734	37,274	37,383	41,990	39,846
うち有担	34,845	35,252	35,447	36,392	36,007

●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非償額募入札(億円)	非償募入札(億円)
流動性供給	426	-	6,500	2025/3/26	-	18,512	6,495		0.029%	45.3460%		0.023%		

●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	応募総額(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		2025/3/27	2025/4/3	4.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/3/25	2025/3/26	0.250	4,294	4,294		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/3/25	2025/3/26	0.250	0	0				

●2025年3月26日の予定

* 1月のサービス産業動態統計速報	* 2月の米耐久財新規受注
* 2月の企業向けサービス	* 2月の英消費者物価指数
* 1月の景気動向指数改訂状況	

◆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