

Central Daily Market Report

2025年3月27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27日 需給速報	2025年3月28日 需給予想	2025年3月31日 当社予想		
銀行券	▲ 600	400	1,800		
財政	12,300	18,900	20,000		
資金過不足	11,700	19,300	21,800		
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			▲ 300		
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	▲ 3,600	3,100	3,600		
当預増減	11,200	22,600	21,800		
当座預金残高	5,276,900	5,299,500	5,321,300		
準備預金残高	4,785,700				
積み終了先	4,784,400			3月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,784,300			積数	8,200
非準備預金先	491,200			1日平均	400
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	99.80%	日数	38.71%	

●2025年3月27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出会いが見られた。また、四半期末越えの取引を控えていた参加者が、4月スタートのターム物で取り組みを再開する動きも見られたことから、4月スタートのオファーに厚みが出始めた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.42~0.47%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>

27日のアウトライ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市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。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

3/27	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	0.565	0.690	0.607		T+0	0.479	1.585	+0.005	37,799.97	▲ 227.32	150.46-47	150.54-55	
T/N				2W					T+1	0.447							
S/N				3W													
2日				1M					1W	0.443							
3日				2M					2W	0.445							
4日				3M		0.740			3W	0.445							
5日				4M		0.800			1M	0.444							
6日				5M				3M	0.280	3M	0.461						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.400	6M	0.502						
O/N			0.430	1Y				1Y	0.590	1Y	0.604						

日付	3/19	3/21	3/24	3/25	3/26
日銀当預残	5,153,200	5,222,300	5,218,000	5,267,300	5,265,700
準備預金残	4,681,100	4,737,000	4,735,300	4,784,300	4,786,000
マネタリーベース	6,387,500	6,456,900	6,452,700	6,501,800	6,500,300
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.476%	0.476%	0.477%
コール市場残高	118,789	123,521	120,562	117,496	118,117
うち無担	83,342	87,129	84,555	82,212	83,275
うちO/N	37,383	41,990	39,846	37,403	38,266
うち有担	35,447	36,392	36,007	35,284	34,842

●入札結果

名称	回数	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非償格額(億円)	非償格額(億円)
40年利付国債	17	2.2%	7,000	2025/3/28	2064/3/20	20,436	6,998	87.77	2.710%	49.0476%				

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/3/27	2025/3/28	0.250	3,668	3,668		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/3/27	2025/3/28	0.250	0	0				

●2025年3月28日の予定

* 決定会合における主な意見(3月18・19日分)	* 2月の米個人所得・消費支出(PCE)	* 国庫短期証券(1296回)入札(3ヶ月、45,000億円、3/31発行)
* 3月の都区部消費者物価指数(CPI)	* 10-12月期の英GDP確報値	

◆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