Central Daily Market Report

2025年4月1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4月1日 需給速報	2025年4月2日 需給予想	2025年4月3日 当社予想		
銀行券	700	400	1,000		
財政	▲ 22,300	▲ 3,200	2,000		
資金過不足	▲ 21,600	▲ 2,800	3,000		
金融調節	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					
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	▲ 5,700	8,500	5,700		
当預増減	▲ 18,800	2,900	3,000		
当座預金残高	5,285,800	5,288,700	5,291,700		
準備預金残高	4,790,600				
積み終了先	4,789,700			4月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,789,600			積数	1,900
非準備預金先	495,200			1日平均	100
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	99.95%	日数	54.84%	

●2025年4月1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、年度末要因が剥落した事により調達を再開した先も見られたが、引き続き資金調達ニーズの強い展開に変わりはなく、レートは0.475~0.478%程度での推移となった。
ターム物はショートターム物を中心に出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.425~0.50%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>

1日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額の出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

4/1	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	0.477	1W	0.484	0.650	0.551	T+0	0.495	
T/N				2W			0.550	T+1	0.481	
S/N				3W			0.600	1W	0.445	
2日				1M	0.550	0.560	0.557	2W	0.443	
3日				2M				3W	0.442	
4日				3M	0.600	0.750	0.700	1M	0.442	
5日				4M				3M	0.462	
6日				5M				6M	0.504	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.604	
O/N			0.430	1Y						

JGB新発10年債		日経平均株価		為替(ドル/円)	
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
1.500	+0.015	35,624.48	+6.92	149.93-95	149.62-64
日付	3/25	3/26	3/27	3/28	3/31
日銀当預残	5,267,300	5,265,700	5,276,900	5,297,500	5,304,600
準備預金残	4,784,300	4,786,000	4,785,600	4,785,500	4,779,600
マネタリーベース	6,501,800	6,500,300	6,512,200	6,532,300	6,537,900
無担O/N加重平均	0.476%	0.477%	0.476%	0.477%	0.476%
コール市場残高	117,496	118,117	116,059	118,906	107,388
うち無担	82,212	83,275	81,560	81,733	74,938
うちO/N	37,403	38,266	37,179	38,072	37,837
うち有担	35,284	34,842	34,499	37,173	32,450

●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)	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		2025/4/3	2025/4/10	4.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/4/1	2025/4/2	0.250	5,824	5,824		0.250	0.250	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2025/4/2	2025/4/16	0.500	15,208	8,005				52.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/4/1	2025/4/2	0.250	0	0				

●2025年4月2日の予定

* 3月のマネタリーベース	* 2月の米製造業新規受注・出荷・在庫
* 財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	

◆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