

Central Daily Market Report

2025年2月10日(月)

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2月10日 需給速報	2025年2月12日 需給予想	2025年2月13日 当社予想
銀行券	1,000	600	1,000
財政	6,300	▲ 8,900	▲ 4,000
資金過不足	7,300	▲ 8,300	▲ 3,000

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,200					
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	▲ 5,100	6,500		5,100		
当預増減	17,900		▲ 3,200		▲ 3,000	

当座預金残高	5,194,600	5,191,400	5,188,400
準備預金残高	4,685,400		
積み終了先	4,685,100		
超過準備	4,685,100		
非準備預金先	509,200		
積み期間(1/16~2/15日)の所要準備額(積数)			4,082,300
準備預金進捗率	実績 99.97%	日数 87.10%	

●2025年2月10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、0.475~0.477%程度での出会いとなった。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.435~0.485%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>

10日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物と1Y物で少額出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は数件の発行が実施された。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

2/10	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	0.525	0.477	1W	0.483	0.550	0.539	T+0	0.467	
T/N				2W			0.660	T+1	0.457	
S/N				3W						
2日				1M			0.620	1W	0.436	
3日				2M			0.580	2W	0.435	
4日				3M			0.700	3W	0.435	
5日				4M				1M	0.434	
6日				5M				3M	0.449	
有担保コール(速報)				6M			0.310	6M	0.480	
O/N			0.430	1Y			0.565	1Y	0.551	

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)
1.310	+0.010	38,801.17	+14.15	151.87-89	152.17-18

日付	2/3	2/4	2/5	2/6	2/7
日銀当預残	5,265,500	5,197,800	5,170,900	5,179,400	5,176,700
準備預金残	4,764,900	4,700,800	4,669,400	4,674,700	4,665,600
マネタリーベース	6,514,500	6,445,500	6,417,700	6,425,400	6,421,700
無担O/N加重平均	0.476%	0.477%	0.479%	0.479%	0.477%
コール市場残高	120,869	122,210	123,800	124,725	121,730
うち無担	81,141	82,790	84,229	86,088	83,028
うちO/N	34,152	36,861	36,810	38,099	35,649
うち有担	39,728	39,420	39,571	38,637	38,702

●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)		2025/2/10	2025/2/12	0.150	5,433	5,433		0.150	0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/2/10	2025/2/12	0.150	0	0				

●2025年2月12日の予定

*1月のマネーストック	*1月の米消費者物価指数 *1月の米財政収支	*10Y物価連動国債入札 (2,500億円、2/13発行)
-------------	---------------------------	----------------------------------

◆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