

Central Daily Market Report

2025年2月21日(金)

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21日 需給速報	2025年2月25日 需給予想	2025年2月26日 当社予想		
銀行券	▲ 100	▲ 200	▲ 500		
財政	▲ 10,100	24,700	▲ 2,000		
資金過不足	▲ 10,200	24,500	▲ 2,500		
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					
CP等買入		▲ 100	▲ 200		
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	▲ 4,300	3,000	4,300		
当増減	▲ 11,600	28,400	▲ 2,500		
当座預金残高	5,295,700	5,324,100	5,321,600		
準備預金残高	4,822,100				
積み終了先	4,820,700			2月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,819,200			積数	7,700
非準備預金先	473,600			1日平均	400
積み期間(2/16~3/15日)の所要準備額(積数)					3,681,900
準備預金進捗率	実績	99.79%	日数	32.14%	

●2025年2月21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。祝日を含む4日積みの取引にあたるものの、ビッドサイドの動向に大きな変化は見られなかった。ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.485~0.50%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>

21日はTDB3M物(第1289回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

<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

2/21	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	0.535	0.478	1W	0.530	0.650	0.556	T+0	0.497	1.423	▲ 0.017	38,776.94	+98.90	149.46-48	150.56-58	
T/N				2W				T+1	0.496							
S/N				3W			0.610	1W	0.447							
2日				1M			0.610	2W	0.441							
3日				2M				3W	0.434							
4日				3M			0.700	1M	0.432							
5日				4M				3M	0.454							
6日			0.630	5M				6M	0.489							
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.605							
O/N			0.430	1Y				1Y	0.564							

日付	2/14	2/17	2/18	2/19	2/20
日銀当預残	5,299,300	5,276,900	5,270,300	5,269,400	5,307,300
準備預金残	4,789,400	4,772,600	4,762,900	4,792,100	4,825,800
マネタリーベース	6,541,700	6,518,800	6,511,300	6,510,500	6,547,900
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	120,482	120,015	120,379	118,632	117,568
うち無担	80,818	80,599	82,915	80,840	80,758
うちO/N	35,749	34,750	36,996	35,541	35,269
うち有担	39,664	39,416	37,464	37,792	36,810

●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非償額競争入札(億円)	非償額入札(億円)
国庫短期証券	1289	-	45,000	2025/2/25	2025/5/26	100,497	34,294.9	99.9205	0.32226%	88.2412%	99.9237	0.3096%	10,705	-
交付税特会	-	-	12,500	2025/3/4	2025/9/3	35,555	12,500		0.610%	50.9240%		0.602%		-

●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)	着札総額(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	平均着札レート・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)		2025/2/21	2025/2/25	0.250	4,538	4,538		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/2/21	2025/2/25	0.250	18	18		0.250	0.250	

●2025年2月24日の予定

*振替休日	*1月のユーロ圏消費者物価指数改定値
-------	--------------------

●2025年2月25日の予定

*1月の企業向けサービス価格指数	*12月の米S&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(4,000億円、2/26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ものがあります。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