Central Daily Market Report

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5月12日 需給連報 2025年5月13日 当社予想 1,300 1,500 財政 ▲ 5,800 ▲ 9,000 ▲ 11,000 資金過不足 ▲ 4,500 ▲ 7,700 ▲ 9,500 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 スタート エンド スタート エンド スタート エンド 日間 日債買現 国債売現 国庫短期証買入 国債買入 (P等買入 ▲ 100 貸出支援基金(球) 対出支援基金(球) 対出支援基金(球) 対出支援基金(球) 対出支援基金(球) を 100 目債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 本 5,800 ▲ 17,500 当産預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 非準備預金残高 4,849,500 指み期間 (4/16~5/15日) の所要準備額 (積数) 3,983,000 1 1,900 可 1 1	●貧金需給							
財政 ▲ 5,800 ▲ 9,000 ▲ 11,000 資金過不足 ▲ 4,500 ▲ 7,700 ▲ 9,500 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 は出 全店共通 ■ 本 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 ★ 100 貸出支援基金(球) 検出支援基金(球) 検 災地支援 ▲ 200 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 単确完成 ● 1,900 本 5,800 ▲ 17,500 単確預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 非準備預金残高 4,849,500 表 4,849,500 非準備預金先 4,849,500 非準備預金先 4,849,500 情数 0 1日平均 0	単位:億円							
資金過不足 ▲ 4,500 ▲ 7,700 ▲ 9,500 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 (登出 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 本 100 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(成) 投出支援基金(成) 投出支援基金(成) 投出支援基金(成) 投出支援基金(成) 投出支援基金(成) 表核変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 1,900 1,900 当預増減 ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当座預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 種	銀行券		1, 300		1, 300	1, 500		
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 国庫短期額買入 国債買入 CP等買入 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(貸) 被災地支援 本 200 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 メールのの 1,900 4,000 1,900	財政	4	5, 800	4	9, 000	1 1,000		
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 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(成) 貸出支援基金(貸) 被災地支援 本 200 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 メトルが生き組制を開発機能 単預増減 ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当座預金残高	資金過不足	1	4, 500	A	7, 700	4	9, 500	
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 (対し支援基金(成)) (対出支援基金(資)) 被災地支援 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 エトルの中の利用の研究機能の ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当産預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 準備預金残高 4,849,500 積み終了先 4,849,500 指過準備 4,849,500 非準備預金先 489,700 10円均 0	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	
国債買現 国債売現 国庫短期証買入 国債買入 CP等買入 食出支援基金(成) 食出支援基金(資) 被災地支援	貸出							
国債売現 国庫短期証買入 国債買入 CP等買入 食出支援基金(成) 食出支援基金(貸) 被災地支援	全店共通						▲ 8,000	
国庫短期証買入 国債買入 CP等買入 負出支援基金(成) 負出支援基金(貸) 被災地支援 ▲ 200 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 メドル用申照用用用用用機機能 当預増減 ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当座預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 種債み終了先 4,849,500 最過準備 4,849,500 最過準備 4,849,500 非準備預金先 489,700	国債買現							
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	国債売現							
CP等買入								
貸出支援基金(成) 貸出支援基金(貸) 被災地支援	国債買入							
貸出支援基金 (貸) 被災地支援	CP等買入		▲ 100					
被災地支援	貸出支援基金(成)							
社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 **F*用金銀用用銀母機能	貸出支援基金(貸)							
気候変動対応オペ ETF買入	被災地支援		▲ 200					
ETF買入 国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 当預増減 ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当座預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 準備預金残高 4,849,500 積み終了先 4,849,500 超過準備 4,849,500 非準備預金先 489,700 1日平均 0	社債等買入							
国債補完供給 ▲ 1,900 4,000 1,900 1,900 1,900 当預増減 ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当座預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 横み終了先 4,849,500 超過準備 4,849,500 指過準備 4,849,500 非準備預金先 489,700 1日平均 0	気候変動対応オペ							
当預増減 ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当座預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 準備預金残高 4,849,500 積み終了先 4,849,500 超過準備 4,849,500 非準備預金先 489,700 非準備預金先 489,700	ETF買入							
当預増減 ▲ 2,700 ▲ 5,800 ▲ 17,500 当座預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 準備預金残高 4,849,500 積み終了先 4,849,500 超過準備 4,849,500 非準備預金先 489,700 5月13日以降の残り所要積立額 積数 0 1日平均 0	国債補完供給	▲ 1,900	4, 000		1, 900			
当座預金残高 5,339,200 5,333,400 5,315,900 準備預金残高 4,849,500 積み終了先 4,849,500 超過準備 4,849,500 排準備預金先 489,700 1日平均 0	米ドル資金供給用担保国債供給							
準備預金残高 4,849,500 積み終了先 4,849,500 超過準備 4,849,500 非準備預金先 489,700 5月13日以降の残り所要積立額 積数 0 1日平均 0	当預増減	A	2, 700		5, 800	A	17, 500	
積み終了先 4,849,500 5月13日以降の残り所要積立額 超過準備 4,849,500 積数 0 非準備預金先 489,700 1日平均 0	当座預金残高	5,	339, 200	5,	333, 400	5, 315, 900		
積み終了先 4,849,500 5月13日以降の残り所要積立額 超過準備 4,849,500 積数 0 非準備預金先 489,700 1日平均 0	準備預金残高							
超過準備 4,849,500 積数 0 非準備預金先 489,700 1日平均 0	積み終了先				5月13日以	降の残り所要積立額		
	超過準備							
積み期間(4/16~5/15日)の所要準備額(積数) 3,983,000	非準備預金先		489, 700		1日平均		0	
	積み期間(4/16~	·5/15日)	の所要	準備額	(積数)	3, 983, 000		

●2025年5月12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、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達 ニーズが見られ、出合いの水準は0.475~0.477%程度で推移した。 ターム物は、1W~1M程度で引き合いが散見された。

〈レポ市場〉

GC T/Nは、0.485~0.495%程度での出合いとなった。 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〉

12日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

〈CP市場〉

90.00%

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

準備預金進捗率 実績

5/12			無担保	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	考統計值	平均值		
O/N	0.450	0.478	0.477	1W						T+0	0.487	
T/N				2W			0.478			T+1	0.489	
S/N				3W								
2日				1M						1W	0.466	
3日				2M						2W	0.463	
4日				3M			0.600			3W	0.460	
5日				4M						1M	0.460	
6日				5M				3M	0.380	3M	0.465	
有担保コール(速報)			艮)	6M				6M	0.400	6M	0.492	
O/N			0.430	1Y				1Y	0.515	1Y	0.570	

100.00% 日数

	JO	JGB新発10年債					日経平	均相	朱価		為替(ドル/円)			
	直記	丘値	前日	3比			終値		前日比		9時	17時		
	1.3	386	+0.	036			,644.26	+140.93			145.83-85	147.91-93		
		•	5/	1		5/2		5/7		5/8	5/9			
	日銀当預残			5,403,100		5,371,200		5,379,500		5,369,000	5,341,900			
	準備預金残			4,895,10		00	4,873,4	00	4,883,400		4,877,200	4,847,200		
	マネタ	リーベ	ース	6,636,400		00	6,604,70		6,611,80	0	6,599,100	6,570,200		
	無担O	/N加i	重平均	0.477%		0.477%		0.477%		0.476%	0.477%			
	コール	127,138		38	118,541		113,207		113,285	111,676				
	うち無担 うちO/N			94	94,839		89,289		83,93	1	84,981	82,934		
				44	,4	33	39,793		34,665		35,900	34,553		
		32,299			29,2	52	29,276		28,304	28,742				

●入札結果

	マノハイレヤロス	<u> </u>													
	名称	回号	表面利率	発行 予定額	発行日	債還日	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 I 非価格 競争入札(像 円)	
ſ	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)		2025/5/12	2025/5/13	0.250	2,054	2,054		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/5/12	2025/5/13	0.250	0	0				

●2025年5月13日の予定

- *決定会合における主な意見(4月30日・5月1日分)
- *4月のマネーストック

- *4月の米消費者物価指数
- *30年利付国債入札 (8,000億円、5/14発行)
- * 交付税特別会計借入 (11,000億円、5/22借入)
- ◆本資料は信頼できると思わ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論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