

Central Daily Market Report

2025年5月15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5月15日 需給速報		2025年5月16日 需給予想		2025年5月19日 当社予想							
銀行券	700		1,200		1,000							
財政	▲ 6,700		▲ 20,000		500							
資金過不足	▲ 6,000		▲ 18,800		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												
国庫短期証買入												
国債買入	6,800											
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	▲ 2,600	2,100		2,600								
※ドル資金供給用国債提供給												
当預増減	300		▲ 16,200		1,500							
当座預金残高	5,319,200		5,303,000		5,304,500							
準備預金残高	4,811,800		<table><tr><td colspan="2">5月16日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>4,107,900</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>132,500</td></tr></table>				5月16日以降の残り所要積立額		積数	4,107,900	1日平均	132,500
5月16日以降の残り所要積立額												
積数	4,107,900											
1日平均	132,500											
積み終了先	4,811,800											
超過準備	4,811,800											
非準備預金先	507,400											
積み期間（5/16～6/15日）の所要準備額（積数）					4,107,900							
準備預金進捗率	実績		0.00%		日数	0.00%						

●2025年5月15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0.475~0.478%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。

＜レボ市場＞
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＞
15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＞
CP発行市場は複数の業態で発行が観測された。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

5/15	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		為替(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	9時	17時
O/N	0.450	0.478	0.477	1W	0.550	0.560	0.552		T+0	0.483	1.475	+0.025	37,755.51	▲ 372.62	146.62-65	145.88-90
T/N				2W					T+1	0.485						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.466						
3日			0.477	2M					2W	0.466						
4日				3M					3W	0.464						
5日				4M					1M	0.463						
6日				5M				3M	0.370	3M	0.469					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.395	6M	0.494					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.540	1Y	0.574					
日付																
5/8																
5/9																
5/12																
5/13																
5/14																
日銀当預残																
5,369,000																
準備預金残																
4,877,200																
マネタリーベース																
6,599,100																
無担O/N加重平均																
0.476%																
コール市場残高																
113,285																
うち無担																
84,981																
うちO/N																
35,900																
うち有担																
28,304																
28,742																
29,008																
28,902																
29,005																

●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	178	1.0%	24,000	2025/5/16	2030/3/20	58,535	18,353	100.03	0.993%	59.2476%	100.09	0.980%	5,641	3.0
国林野借入	-	-	419	2025/5/26	2030/5/25	1,607	419		0.958%	88.0669%		0.957%		

●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)		2025/5/15	2025/5/16	0.250	2,641	2,641		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/5/15	2025/5/16	0.250	0	0				

●2025年5月16日の予定

* 中村審議委員 西日本政経懇話会における講演	* 4月の米住宅着工件数	* 国庫短期証券(1306回)入札(3ヶ月、45,000億円、5/19発行)
* 1-3月期のGDP 1次速報	* 5月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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