

Central Daily Market Report

2025年5月21日(水)

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21日 需給速報	2025年5月22日 需給予想	2025年5月23日 当社予想	
銀行券	500	▲ 500	500	
財政	▲ 14,200	9,300	▲ 3,500	
資金過不足	▲ 13,700	8,800	▲ 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				
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入			▲ 100	
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		▲ 400		
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 2,300	1,400	2,300	
※ドル資金供給用国債補完供給				
当預増減	▲ 15,000	11,000	▲ 3,000	
当座預金残高	5,300,600	5,311,600	5,308,600	
準備預金残高	4,811,600			
積み終了先	4,808,100			5月22日以降の残り所要積立額
超過準備	4,808,000			積数 20,100
非準備預金先	489,000			1日平均 800
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 99.51%			日数 19.35%

●2025年5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、0.475~0.478%程度での出会いとなった。
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、0.49~0.495%程度での出会いとなった。
SCI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物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数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

5/21	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		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	0.477	0.610	0.496		T+0	0.490	1.515	0.000	37,298.98	▲ 230.51	144.30-32	143.88-90	
T/N				2W					T+1	0.494							
S/N				3W													
2日				1M					1W	0.474							
3日				2M					2W	0.470							
4日				3M			0.590		3W	0.469							
5日				4M					1M	0.471							
6日				5M				3M	0.355	3M	0.477						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.385	6M	0.495						
O/N			0.430	1Y				1Y	0.555	1Y	0.573						

日付	5/14	5/15	5/16	5/19	5/20
日銀当預残	5,318,900	5,319,200	5,301,800	5,310,100	5,315,600
準備預金残	4,823,500	4,811,800	4,806,500	4,811,200	4,809,900
マネタリーベース	6,543,200	6,542,800	6,524,200	6,532,000	6,536,900
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.478%	0.478%
コール市場残高	114,538	114,341	115,460	116,991	121,258
うち無担	85,533	83,870	84,336	85,906	90,152
うちO/N	36,282	34,459	34,705	35,475	39,601
うち有担	29,005	30,471	31,124	31,085	31,106

●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)		2025/5/21	2025/5/22	0.250	2,309	2,309		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/5/21	2025/5/22	0.250	132	132		0.250	0.250	

●2025年5月22日の予定

* 野口審議委員 宮崎県金融経済懇談会における挨拶 * 3月の機械受注統計	* 4月の米中古住宅販売件数	* 10Y物価連動国債入札 (2,500億円、5/23発行) * 交付税特別会計借入 (11,000億円、5/30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り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