

Central Daily Market Report

2025年5月27日(火)

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27日 需給速報	2025年5月28日 需給予想	2025年5月29日 当社予想
銀行券	500	100	900
財政	5,900	▲ 5,900	▲ 7,000
資金過不足	6,400	▲ 5,800	▲ 6,100
金融調節	スタート	スタート	スタート
貸出	エンド	エンド	エンド
全店共通		8,000 ▲ 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	▲ 300	▲ 100	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 900	1,200	900
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	6,400	▲ 5,100	▲ 6,100
当座預金残高	5,333,800	5,328,700	5,322,600
準備預金残高	4,845,200		
積み終了先	4,843,600		5月28日以降の残り所要積立額
超過準備	4,843,600		積数 7,200
非準備預金先	488,600		1日平均 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 99.82%	日数 38.71%	

●2025年5月27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~3M程度での引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.49~0.50%程度での出合いとなった。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>

27日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<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

5/27	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	0.478	0.476	1W					T+0	0.491	
T/N				2W					T+1	0.488	
S/N				3W		0.530			1W	0.475	
2日				1M		0.545			2W	0.474	
3日				2M					3W	0.472	
4日				3M		0.595			1M	0.473	
5日				4M					3M	0.481	
6日				5M					6M	0.498	
有担保コール(速報)				6M					1Y	0.572	
O/N			0.430	1Y							

JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)	
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
1.460	▲ 0.045	37,724.11	+192.58	142.61-63	143.73-75
日付	5/20	5/21	5/22	5/23	5/26
日銀当預残	5,315,600	5,300,600	5,307,600	5,315,800	5,327,400
準備預金残	4,809,900	4,811,600	4,829,000	4,830,300	4,839,600
マネタリーベース	6,536,900	6,521,400	6,528,800	6,537,000	6,548,500
無担O/N加重平均	0.478%	0.477%	0.476%	0.477%	0.476%
コール市場残高	121,258	118,775	117,352	115,650	115,652
うち無担	90,152	87,816	85,627	83,394	83,412
うちO/N	39,601	37,715	36,026	34,863	34,011
うち有担	31,106	30,959	31,725	32,256	32,240

●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
米ドル資金供給		2025/5/29	2025/6/5	4.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア一分)		2025/5/27	2025/5/28	0.250	960	960		0.250	0.250	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2025/5/28	2025/6/11	0.500	13,753	8,005				58.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア一分)		2025/5/27	2025/5/28	0.250	0	0				

●2025年5月28日の予定

* 40年利付国債入札 (5,000億円、5/29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