

Central Daily Market Report

2025年6月16日(月)

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6月16日 需給速報	2025年6月17日 需給予想	2025年6月18日 当社予想			
銀行券	200	0	▲ 300			
財政	▲ 6,800	800	1,000			
資金過不足	▲ 6,600	800	700			
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	9,700					
CP等買入			▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					70,200	▲ 94,100
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 300		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 2,500	2,600		2,500		
※ドル資金供給用国債補完供給						
当預増減	3,100	2,900	▲ 23,200			
当座預金残高	5,295,300	5,298,200	5,275,000			
準備預金残高	4,820,300					
積み終了先	3,439,900			6月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,356,700			積数	531,800	
非準備預金先	475,000			1日平均	18,300	
積み期間(6/16~7/15日)の所要準備額(積数)					3,995,400	
準備預金進捗率	実績	86.69%	日数	3.33%		

●2025年6月16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たものの、出合いの水準に変化はなく0.475~0.478%程度で推移した。ターム物は証券業態からの調達を中心に1W~3M程度で引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.485~0.490%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＞

16日のアウトライ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、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

6/16	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	0.477	1W					T+0	0.485	
T/N			0.630	2W		0.478			T+1	0.485	
S/N				3W					1W	0.481	
2日				1M		0.670			2W	0.478	
3日				2M					3W	0.477	
4日				3M					1M	0.478	
5日				4M					3M	0.487	
6日				5M			3M	0.430	6M	0.455	
有担保コール(速報)				6M			6M	0.500	1Y	0.570	
O/N			0.430	1Y			1Y	0.555			

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
1.450	+0.051	38,311.33	+477.08	144.56-58	144.17-20
日付	6/9	6/10	6/11	6/12	6/13
日銀当預残	5,198,600	5,209,900	5,195,700	5,202,100	5,292,200
準備預金残	4,722,000	4,735,900	4,725,400	4,726,400	4,807,600
マネタリーベース	6,415,300	6,426,000	6,411,700	6,418,000	6,507,900
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.481%	0.477%
コール市場残高	112,704	112,478	113,817	118,569	114,844
うち無担	83,394	83,103	84,714	87,629	81,624
うちO/N	33,675	32,904	33,315	35,980	32,225
うち有担	29,310	29,375	29,103	30,940	33,220

●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	応募総額(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)		2025/6/16	2025/6/17	0.250	2,519	2,519		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/6/16	2025/6/17	0.250	97	97		0.250	0.250	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
貸出増加支援オペ	貸付期間1年	2025/6/18	2026/6/18	変動※	70,188					

※貸付期間中の補完当座預金制度の適用利率の平均値。

●2025年6月17日の予定

* 日銀金融政策決定会合(2日目)	* 米FOMC(1日目)	* 5月の米小売売上高
* 日銀総裁定例会見	* 4月の米企業在庫	* 5月の米鉱工業生産・設備稼働率

◆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