

Central Daily Market Report

2025年6月20日(金)

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20日 需給速報	2025年6月23日 需給予想	2025年6月24日 当社予想	
銀行券	0	▲ 200	▲ 1,500	
財政	17,700	▲ 2,300	▲ 1,000	
資金過不足	17,700	▲ 2,500	▲ 2,500	
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				
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入		7,100		
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	▲ 600			
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 1,500	300	1,500	
当預増減	15,900	6,100	▲ 2,500	
当座預金残高	5,299,400	5,305,500	5,303,000	
準備預金残高	4,837,400			
積み終了先	4,833,900			
超過準備	4,833,800			
非準備預金先	462,000			
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	99.61%	日数	23.33%

●2025年6月20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、出会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、0.485~0.500%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>

20日はTDB3M物(第1314回)の入札が実施され、事前予想より強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、強含みで推移した。このほか、1Y物でも出会いが見られた。

<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

6/20	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	0.550	0.570	0.560	T+0	0.496		
T/N				2W				T+1	0.493		
S/N				3W			0.475	1W	0.481		
2日				1M				2W	0.477		
3日				2M			0.570	3W	0.478		
4日				3M	0.580	0.700	0.665	1M	0.478		
5日				4M				3M	0.484		
6日			0.460	5M				6M	0.445		
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.550		
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
1.395	▲ 0.015	38,403.23	▲ 85.11	145.23-25	145.40-42
日付	6/13	6/16	6/17	6/18	6/19
日銀当預残	5,292,200	5,295,300	5,294,500	5,273,900	5,283,500
準備預金残	4,807,600	4,820,300	4,822,500	4,800,300	4,811,700
マネタリーベース	6,507,900	6,510,900	6,510,100	6,489,500	6,499,400
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.478%	0.477%
コール市場残高	114,844	113,511	112,421	112,155	111,430
うち無担	81,624	82,058	81,364	80,776	80,221
うちO/N	32,225	32,639	31,515	31,492	31,597
うち有担	33,220	31,453	31,057	31,379	31,209

●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1314	-	44,000	2025/6/23	2025/9/22	135,614.3	33,469.9	99.8925	0.4316%	65.1823%	99.8952	0.4207%	10,530	

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,750	2025/6/23			8,528	2,752	0.005		0.007	10.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2025/6/23			6,316	3,007	▲0.003		0.002	22.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,350	2025/6/23			3,183	1,355	0.010		0.012	56.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/6/20	2025/6/23	0.250	1,419	1,419		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/6/20	2025/6/23	0.250	62	62		0.250	0.250	

●2025年6月23日の予定

* 4月のサービス産業動態統計速報	* 5月の米中古住宅販売件数
-------------------	----------------

◆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