Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

●貧金需給							
単位:億円	2025年(需給		2025年6 需給	6月26日 予想	2025年6月27日 当社予想		
銀行券		▲ 500		▲ 900	▲ 1,000		
財政	A	4, 000		3, 000	3, 000		
資金過不足	A	4, 500		2, 100	2, 000		
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	8, 000	▲ 8,000					
国債買現							
国債売現							
国庫短期証買入							
国債買入			7, 000				
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		▲ 500					
気候変動対応オペ							
ETF買入							
国債補完供給	▲ 1,900	3, 900		1, 900			
米ドル資金供給用担保国債供給							
当預増減		3,000		11, 000		2, 000	
当座預金残高	5, 2	298, 100	5, 3	309, 100	5, 311, 100		
準備預金残高	4, 8	823, 600					
積み終了先		822, 000		6月26日以	降の残り剤	听要積立額	
超過準備	4, 8	822, 000		積数		9, 300	
非準備預金先	4	474, 500		1日平均		500	
積み期間 (6/16~	7/15日)	の所要	準備額	(積数)	3, 9	995, 400	

●2025年6月25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、0.485~0.50%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〉

25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〉

33. 33%

CP発行市場は、複数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

準備預金進捗率 実績

6/25			無担保	短国		東京レポレート					
単位:%	最低	最低 最高 平均			最低	最低 最高 平均		売買参考統計値		平均值	
O/N	0.450	0.525	0.478	1W	0.481	0.483	0.483			T+0	0.490
T/N				2W						T+1	0.485
S/N				3W							
2日				1M						1W	0.476
3日				2M			0.560			2W	0.476
4日				3M						3W	0.476
5日				4M						1M	0.477
6日				5M				3M	0.370	3M	0.484
有担保コール(速報)		6M				6M	0.440	6M	0.500		
O/N			0.430	1Y				1Y	0.550	1Y	0.571

99.77% 日数

	JGE	新発	10年債	(%)	F	日経平均	株	価(円)	為替(ドル/円)				
	直記	近値	前日	3比		終値		前日比		9時	17時		
	1.3	395	A (0.020	38,942.07		+151.51			144.93-94	145.30-33		
		日付		6/1	8	6/19		6/20		6/23	6/24		
ı	日銀当預残			5,273,	900	5,283,5	500 5,299,4		00	5,300,700	5,301,100		
ı	準備預	金残		4,800,300		4,811,700		4,837,400		4,837,100	4,830,500		
ı	マネタ	リーベ	ース	6,489,500		6,499,400		6,515,200		6,516,800	6,517,900		
ı	無担O	/N加i	重平均	0.4	78%	0.477%		0.477%		6 0.476%	0.478%		
ı	コール市場残高		浅高	112,155		111,430		112,954		114,939	117,156		
ı	うち無担 うちO/N		担	80,	776	6 80,22		81,180		83,615	85,339		
ı			550/N	31,	492	31,5	97	32,70	0(32,531	33,035		
ı	うち有担			31.	379	31.2	09	31.7	74	31.324	31.817		

●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 I 非価格 競争入札(億 円)	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

1H213										
禮類	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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,750	2025/6/26			6,637	2,754	▲0.004		▲0.003	66.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2025/6/26			4,863	3,003	▲0.018		▲0.014	50.0
国債買入(残存期間25年超)	750	2025/6/26			1,693	752	▲0.009		▲0.007	100.0
国債買入(物価連動債)	500	2025/6/26			2,059	501	▲0.060		▲0.189	15.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/6/25	2025/6/26	0.250	1,976	1,976		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/6/25	2025/6/26	0.250	n	0				

●2025年6月26日の予定

- *1-3月期の米GDP確報値
- *5月の米耐久財新規受注

- *2年利付国債入札
 - (26,000億円、7/1発行)
- ◆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論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