

Central Daily Market Report

2025年6月26日(木)

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26日 需給速報	2025年6月27日 需給予想	2025年6月30日 当社予想		
銀行券	▲ 900	▲ 400	▲ 500		
財政	1,000	▲ 2,500	2,400		
資金過不足	100	▲ 2,900	1,900		
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	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					
気候変動対応オペ					
E T F買入					
国債補完供給	▲ 1,100	1,900	1,100		
当預増減	7,900	▲ 1,800	1,900		
当座預金残高	5,306,000	5,304,200	5,306,100		
準備預金残高	4,839,000				
積み終了先	4,837,300			6月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,837,300			積数	7,700
非準備預金先	467,000			1日平均	400
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	99.81%	日数	36.67%	

●2025年6月26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0.475~0.525%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、0.48~0.495%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>

26日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物と6M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。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

6/26	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(円)		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	0.525	0.478	1W	0.540	0.580	0.547	T+0	0.490	1.415	+0.020	39,584.58	+642.51	144.90-92	144.05-07	
T/N				2W				T+1	0.485							
S/N				3W				1W	0.473							
2日				1M		0.560		2W	0.476							
3日				2M				3W	0.476							
4日				3M	0.660	0.700	0.668	1M	0.478							
5日				4M				3M	0.484							
6日				5M				6M	0.500							
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.550							
O/N			0.430	1Y				1Y	0.571							

日付	6/19	6/20	6/23	6/24	6/25
日銀当預残	5,283,500	5,299,400	5,300,700	5,301,100	5,298,100
準備預金残	4,811,700	4,837,400	4,837,100	4,830,500	4,823,600
マネタリーベース	6,499,400	6,515,200	6,516,800	6,517,900	6,515,400
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.476%	0.478%	0.478%
コール市場残高	111,430	112,954	114,939	117,156	114,986
うち無担	80,221	81,180	83,615	85,339	84,472
うちO/N	31,597	32,706	32,531	33,035	31,808
うち有担	31,209	31,774	31,324	31,817	30,514

●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)
2年利付国債	474	0.7%	26,000	2025/7/1	2027/7/1	77,167	19,772	99,930	0.735%	36.5535%	99.942	0.729%	6,219	0.69

●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)		2025/6/26	2025/6/27	0.250	1,181	1,181		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/6/26	2025/6/27	0.250	0	0				

●2025年6月27日の予定

* 6月の都区部消費者物価指数(CPI)	* 5月の米個人所得・消費支出(PCE)	* 国庫短期証券(1315回)入札(3ヶ月、44,000億円、6/30発行)
* 5月の労働力調査(完全失業率)		
* 5月の一般職業紹介状況(有効求人倍率)		
* 1-3月期の資金循環統計速報		
* 5月の商業動態統計速報		

◆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