

Central Daily Market Report

2025年6月30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30日 需給速報	2025年7月1日 需給予想	2025年7月2日 当社予想	
銀行券	100	▲ 1,200	500	
財政	▲ 6,900	▲ 21,800	▲ 56,000	
資金過不足	▲ 6,800	▲ 23,000	▲ 55,500	
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				
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	▲ 1,700	800	1,700	
当預増減	▲ 7,700	▲ 21,300	▲ 55,500	
当座預金残高	5,291,500	5,270,200	5,214,700	
準備預金残高	4,800,600			
積み終了先	4,800,100			
超過準備	4,800,000			
非準備預金先	490,900			
7月1日以降の残り所要積立額				
積数		4,800		
1日平均		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	99.88%	日数	50.00%

●2025年6月30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、四半期末を挟む取引となり、一部で調達を控える動きも見られたものの、引き続き国内勢を中心とした資金調達ニーズは強く、出合いの水準は0.475~0.478%程度と横ばいで推移した。ターム物はショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.485~0.495%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>

30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、案件が乏しく閑散としたマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

6/30	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	最低	最高	平均	直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時	
O/N	0.450	0.478	0.477	1W		0.482			T+0	0.491	1.430	+0.001	40,487.39	+336.60	144.50-52	144.12-14
T/N				2W		0.550			T+1	0.488						
S/N				3W												
2日				1M	0.560	0.630	0.572		1W	0.478						
3日				2M			0.550		2W	0.477						
4日				3M			0.600		3W	0.477						
5日				4M			0.650		1M	0.478						
6日				5M				3M	0.430	3M	0.485					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.450	6M	0.500					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.550	1Y	0.570					

日付	6/23	6/24	6/25	6/26	6/27
日銀当預残	5,300,700	5,301,100	5,298,100	5,306,000	5,299,200
準備預金残	4,837,100	4,830,500	4,823,600	4,839,000	4,819,500
マネタリーベース	6,516,800	6,517,900	6,515,400	6,524,200	6,517,900
無担O/N加重平均	0.476%	0.478%	0.478%	0.478%	0.477%
コール市場残高	114,939	117,156	114,986	112,757	109,488
うち無担	83,615	85,339	84,472	82,430	79,380
うちO/N	32,531	33,035	31,808	30,266	28,326
うち有担	31,324	31,817	30,514	30,327	30,108

●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)		2025/6/30	2025/7/1	0.250	1,761	1,761		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/6/30	2025/7/1	0.250	0	0				

●2025年7月1日の予定

* 6月調査の日銀短観(概要及び要旨)	* 6月のISM製造業景況指数	* 10年利付国債入札(26,000億円、7/2発行)
* 6月の消費動向調査	* 5月の米建設支出	
	* 6月のユーロ圏消費者物価指数速報値	

◆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