Central Daily Market Report

2025年7月1日(火)

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7月1日 需給速報	2025年7月2日 需給予想	2025年7月3日 当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 400	▲ 500
財政	▲ 18,000	▲ 61,100	0
資金過不足	▲ 19,200	▲ 61,500	▲ 500

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						
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	▲ 6,000	1,700		6,000		
当預増減	▲ 23,500		▲ 55,500		▲ 500	

当座預金残高	5,268,000	5,212,500	5,212,000	
準備預金残高	4,798,200			
積み終了先	4,797,500			
超過準備	4,797,500			
非準備預金先	469,800			
7月2日以降の残り所要積立額				
積数		4.100		
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	99.90%	日数	53.33%

●短期金融市場関連指標

7/1	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	0.481	0.610	0.522	T+0	0.482	
T/N				2W	0.535	0.580	0.544	T+1	0.491	
S/N				3W				1W	0.479	
2日				1M	0.515	0.600	0.558	2W	0.479	
3日				2M				3W	0.479	
4日				3M			0.600	1M	0.480	
5日				4M				3M	0.485	
6日				5M				6M	0.500	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.570	
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	
1.410	▲ 0.020	39,986.33	▲ 501.06	143.80-82	143.07-09	
日付		6/24	6/25	6/26	6/27	6/30
日銀当預残	5,301,100	5,298,100	5,306,000	5,299,200	5,291,500	
準備預金残	4,830,500	4,823,600	4,839,000	4,819,500	4,800,600	
マネタリーベース	6,517,900	6,515,400	6,524,200	6,517,900	6,510,100	
無担O/N加重平均	0.478%	0.478%	0.478%	0.477%	0.477%	
コール市場残高	117,156	114,986	112,757	109,488	106,025	
うち無担	85,339	84,472	82,430	79,380	78,127	
うちO/N	33,035	31,808	30,266	28,326	31,143	
うち有担	31,817	30,514	30,327	30,108	27,898	

●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)
10年利付国債	379	1.5%	26,000	2025/7/2	2035/6/20	69,354	19,776	100.47	1.446%	96.5206%	100.50	1.442%	6,219	3,19

●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
米ドル資金供給		2025/7/3	2025/7/10	4.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/7/1	2025/7/2	0.250	6,333	6,333		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/7/1	2025/7/2	0.250	0	0				

●2025年7月2日の予定

- * 6月のマネタリーベース
- * 財政資金対民間収支前月実績/当月見込み

◆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ことがあります。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

●2025年7月1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、四半期末要因が剥落したこともあり、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、0.49~0.495%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>

1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>

CP発行市場は数件の入札が実施され、一部大型発行も見られた。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。