

Central Daily Market Report

2025年8月4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8月4日 需給速報	2025年8月5日 需給予想	2025年8月6日 当社予想
銀行券	100	500	900
財政	▲ 61,700	3,800	▲ 26,000
資金過不足	▲ 61,600	4,300	▲ 25,100

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	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
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	▲ 4,300	2,600		4,300				
当増減	▲ 63,300		8,600		▲ 33,100			

当座預金残高	5,200,600	5,209,200	5,176,100
準備預金残高	4,719,100		
積み終了先	4,719,100		
超過準備	4,719,100		
非準備預金先	481,500		
積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(積数)		4,121,200	
準備預金進捗率	実績 99.99%	日数 64.52%	

●2025年8月4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、前週に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0.475~0.477%程度で推移した。ターム物は、ショートタームを中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.465~0.495%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>

4日のアウトライト市場は、3M物、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は数件の発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

8/4 単位: %	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
	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	0.476	1W	0.484	0.610	0.545	T+0	0.496	
T/N				2W			0.478	T+1	0.493	
S/N				3W				1W	0.482	
2日				1M			0.530	2W	0.482	
3日				2M				3W	0.481	
4日				3M	0.585	0.590	0.588	1M	0.482	
5日				4M				3M	0.497	
6日			0.460	5M				6M	0.529	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.611	
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
1.505	▲ 0.045	40,290.70	▲ 508.90	147.33-36	147.87-89

日付	7/28	7/29	7/30	7/31	8/1
日銀当預残	5,244,400	5,250,800	5,250,100	5,244,900	5,263,900
準備預金残	4,764,600	4,775,400	4,773,000	4,746,500	4,777,900
マネタリーベース	6,462,800	6,469,200	6,468,300	6,463,600	6,482,900
無担O/N加重平均	0.479%	0.478%	0.481%	0.478%	0.477%
コール市場残高	114,207	112,513	115,905	109,471	113,380
うち無担	82,302	81,723	84,838	80,651	79,237
うちO/N	31,010	30,731	33,916	32,439	29,795
うち有担	31,905	30,790	31,067	28,820	34,143

●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)		2025/8/4	2025/8/5	0.250	3,560	3,560		0.250	0.207	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/4	2025/8/5	0.250	1,000	1,000		0.250	0.250	

●2025年8月5日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(6月16・17日分)	*6月の米貿易収支	*10年利付国債入札(26,000億円、8/6発行)
*8月の日銀当座預金増減要因見込み	*7月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、8/14借入)

◆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