

Central Daily Market Report

2025年8月5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8月5日 需給速報	2025年8月6日 需給予想	2025年8月7日 当社予想	
銀行券	600	▲ 100	▲ 300	
財政	2,600	▲ 26,200	2,000	
資金過不足	3,200	▲ 26,300	1,700	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出	スタート	スタート	スタート	
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				
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	▲ 3,000	3,600	3,000	
当預増減	3,800	▲ 23,300	1,700	
当座預金残高	5,204,400	5,181,100	5,182,800	
準備預金残高	4,710,000			
積み終了先	4,709,900			
超過準備	4,709,900			
非準備預金先	494,400			
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	100.00%	日数	67.74%

●2025年8月5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0.475~0.477%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、0.49~0.50%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>

5日のアウトライト市場は、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数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

8/5	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	0.600	0.477	1W	0.481	0.550	0.503	T+0	0.490	
T/N				2W				T+1	0.492	
S/N				3W				1W	0.482	
2日				1M			0.620	2W	0.482	
3日				2M				3W	0.481	
4日				3M	0.595	0.700	0.616	1M	0.483	
5日				4M				3M	0.497	
6日				5M				6M	0.529	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.609	
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
1.470	▲ 0.035	40,549.54	+258.84	146.76-79	147.36-38
日付	7/29	7/30	7/31	8/1	8/4
日銀当預残	5,250,800	5,250,100	5,244,900	5,263,900	5,200,600
準備預金残	4,775,400	4,773,000	4,746,500	4,777,900	4,719,100
マネタリーベース	6,469,200	6,468,300	6,463,600	6,482,900	6,419,500
無担O/N加重平均	0.478%	0.481%	0.478%	0.477%	0.476%
コール市場残高	112,513	115,905	109,471	113,380	110,177
うち無担	81,723	84,838	80,651	79,237	79,103
うちO/N	30,731	33,916	32,439	29,795	29,251
うち有担	30,790	31,067	28,820	34,143	31,074

●入札結果

名称	回数	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	2025/8/6	2035/6/20	61,408	20,073	100.18	1.479%	86.7516%	100.32	1.462%	5,921	2.28
交付税特会	-	-	10,500	2025/8/14	2026/2/13	42,761	10,500		0.625%	56.5720%		0.605%		-

●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		2025/8/7	2025/8/14	4.570	2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/8/5	2025/8/6	0.250	3,039	3,039		0.250	0.250	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2025/8/6	2025/8/20	0.500	16,895	8,005				47.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/5	2025/8/6	0.250	200	200		0.250	0.250	

●2025年8月6日の予定

*6月の毎月勤労統計調査速報

◆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