

# Central Daily Market Report

2025年8月12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12日 需給速報	2025年8月13日 需給予想	2025年8月14日 当社予想			
銀行券	▲ 200	200	▲ 500			
財政	▲ 9,600	1,100	▲ 22,000			
資金過不足	▲ 9,800	1,300	▲ 22,500			
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	▲ 800	500	800			
当預増減	▲ 10,100	2,100	▲ 22,500			
当座預金残高	5,176,400	5,178,500	5,156,000			
準備預金残高	4,731,800					
積み終了先	4,731,800			8月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,731,800			積数	0	
非準備預金先	444,600			1日平均	0	
積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(積数)				4,113,100		
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	90.32%		

## ●2025年8月12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たものの、出会いの水準に特段の変化はなく、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見られた。

### <レボ市場>

GC T/Nは、0.49~0.495%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>

12日のアウトライイト市場は、3M物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

8/12	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	0.477	1W	0.484	0.550	0.496		T+0	0.490	1.499	+0.014	42,718.17	+897.69	148.15-16	148.26-27	
T/N				2W					T+1	0.490							
S/N				3W													
2日				1M			0.710		1W	0.482							
3日			0.530	2M					2W	0.482							
4日				3M			0.600		3W	0.482							
5日				4M					1M	0.484							
6日			0.630	5M				3M	0.415	3M	0.497						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.490	6M	0.530						
O/N			0.430	1Y				1Y	0.605	1Y	0.609						

日付	8/4	8/5	8/6	8/7	8/8
日銀当預残	5,200,600	5,204,400	5,179,800	5,191,400	5,186,500
準備預金残	4,719,100	4,710,000	4,702,500	4,728,600	4,732,300
マネタリーベース	6,419,500	6,422,700	6,398,100	6,410,600	6,406,100
無担O/N加重平均	0.476%	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	110,177	113,285	112,184	116,664	116,749
うち無担	79,103	82,139	80,869	83,532	83,908
うちO/N	29,251	32,423	30,003	31,056	31,312
うち有担	31,074	31,146	31,315	33,132	32,841

## ●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
米ドル資金供給		2025/8/14	2025/8/21	4.580	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/8/12	2025/8/13	0.250	946	946		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/12	2025/8/13	0.250	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2025/8/13	2025/8/22	0.470	2	2		0.470	0.470	

## ●2025年8月13日の予定

*7月の企業物価指数	*5年利付国債入札(24,000億円、8/14発行)
------------	----------------------------

◆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