

Central Daily Market Report

2025年8月13日(水)

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13日 需給速報	2025年8月14日 需給予想	2025年8月15日 当社予想
銀行券	300	▲ 600	▲ 500
財政	▲ 7,000	▲ 23,000	76,000
資金過不足	▲ 6,700	▲ 23,600	75,500

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	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				▲ 200				
貸出支援基金(成)								
貸出支援基金(貸)								
被災地支援								
社債等買入				▲ 200				
気候変動対応オペ								
E T F 買入								
国債補完供給	▲ 600	800		600				
当預増減	▲ 6,500		▲ 23,400				75,500	

当座預金残高	5,169,900	5,146,500	5,222,000	
準備預金残高	4,717,200			
積み終了先	4,717,200			
超過準備	4,717,200			
非準備預金先	452,700			
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	93.55%

●2025年8月13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、出会いの水準は特段変わらず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、0.49~0.495%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>

13日のアウトライイト市場は、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

8/13 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	0.477	1W		0.484		T+0	0.487	
T/N				2W	0.478	0.550	0.491	T+1	0.490	
S/N				3W		0.560				
2日				1M				1W	0.482	
3日				2M				2W	0.482	
4日				3M		0.605		3W	0.481	
5日				4M				1M	0.484	
6日				5M			3M	0.415	3M	0.498
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

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
1.515	+0.016	43,274.67	+556.50	147.76-78	147.52-54

日付	8/5	8/6	8/7	8/8	8/12
日銀当預残	5,204,400	5,179,800	5,191,400	5,186,500	5,176,400
準備預金残	4,710,000	4,702,500	4,728,600	4,732,300	4,731,500
マネタリーベース	6,422,700	6,398,100	6,410,600	6,406,100	6,396,200
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	113,285	112,184	116,664	116,749	115,504
うち無担	82,139	80,869	83,532	83,908	82,194
うちO/N	32,423	30,003	31,056	31,312	30,568
うち有担	31,146	31,315	33,132	32,841	33,310

●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)
5年利付国債	179	1.0%	24,000	2025/8/14	2030/6/20	54,555	18,421	99.71	1.062%	67.7077%	99.74	1.056%	5,572	0.00

●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)		2025/8/13	2025/8/14	0.250	677	677		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/13	2025/8/14	0.250	0	0				

●2025年8月14日の予定

*7月の米生産者物価指数	*国有林野特別会計借入(949億円、8/25借入)
*4-6月期のユーロ圏GDP2次速報	
*4-6月期の英GDP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