

Central Daily Market Report

2025年8月15日(金)

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15日 需給速報	2025年8月18日 需給予想	2025年8月19日 当社予想	
銀行券	700	200	1,000	
財政	73,800	▲ 4,000	▲ 1,000	
資金過不足	74,500	▲ 3,800	0	
金融調節	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	8,500			
CP等買入				
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援		100	▲ 300	
社債等買入				
気候変動対応オペ				
ETF買入				
国債補完供給	▲ 400	500	400	
当預増減	83,100	▲ 3,600	0	
当座預金残高	5,229,700	5,226,100	5,226,100	
準備預金残高	4,781,000			
積み終了先	4,781,000			8月18日以降の残り所要積立額
超過準備	4,781,000			積数 108,400
非準備預金先	448,700			1日平均 3,700
積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(積数)				4,108,500
準備預金進捗率	実績 97.36%			日数 6.45%

●2025年8月15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>

15日はTDB3M物(第1325回)の入札が実施され、レート調整が行われ前回債対比で上昇する結果となったが、結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<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

8/15	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	0.478	0.477	1W		0.560			T+0	0.491	1.560	+0.010	43,378.31	+729.05	147.68-71	147.00-02
T/N				2W	0.481	0.580	0.506		T+1	0.491						
S/N				3W		0.620			1W	0.482						
2日			0.460	1M		0.610			2W	0.482						
3日				2M					3W	0.482						
4日			0.525	3M		0.605			1M	0.484						
5日				4M					3M	0.500						
6日				5M					6M	0.490						
有担保コール(速報)				6M					1Y	0.609						
O/N			0.430	1Y												

日付	8/7	8/8	8/12	8/13	8/14
日銀当預残	5,191,400	5,186,500	5,176,400	5,169,900	5,146,600
準備預金残	4,728,600	4,732,300	4,731,500	4,717,200	4,702,300
マネタリーベース	6,410,600	6,406,100	6,396,200	6,389,400	6,366,700
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	116,664	116,749	115,504	114,973	116,576
うち無担	83,532	83,908	82,194	81,399	82,133
うちO/N	31,056	31,312	30,568	30,373	31,107
うち有担	33,132	32,841	33,310	33,574	34,443

●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)
国庫短期証券	1325	-	43,000	2025/8/18	2025/11/17	105,396	33,253.7	99,889.0	0.4457%	53.3154%	99.8919	0.4340%	9,746	
物産連動10年	30	0.005%	2,500	2025/8/18	2035/3/10	7,292	2,500	99.30	0.078%	20.0000%				

●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)		2025/8/15	2025/8/18	0.250	488	488		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/15	2025/8/18	0.250	0	0				

●2025年8月18日の予定

*6月の第3次産業活動指数

◆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