

Central Daily Market Report

2025年8月20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20日 需給速報	2025年8月21日 需給予想	2025年8月22日 当社予想			
銀行券	▲ 700	▲ 300	▲ 1,000			
財政	▲ 3,100	14,800	▲ 6,500			
資金過不足	▲ 3,800	14,500	▲ 7,500			
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	8,000	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,900			
CP等買入			▲ 100			
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	▲ 200	500	200			
当預増減	▲ 3,500	24,500	▲ 7,500			
当座預金残高	5,222,200	5,246,700	5,239,200			
準備預金残高	4,773,300					
積み終了先	4,769,100			8月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,768,100			積数	20,000	
非準備預金先	448,900			1日平均	800	
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	99.51%	日数	16.13%		

●2025年8月20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、0.495~0.50%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>

20日のアウトライト市場は、6M物で出会いが見られた。

<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あった。

●短期金融市場関連指標

8/20	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	最低	最高	平均	直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時			
O/N	0.450	0.478	0.476	1W	0.470	0.484	0.478			T+0	0.492	1.605	+0.015	42,888.55	▲ 657.74	147.73-74	147.62-64	
T/N				2W	0.478	0.481	0.478			T+1	0.491							
S/N				3W			0.550											
2日				1M			0.525			1W	0.483							
3日				2M						2W	0.482							
4日				3M						3W	0.482							
5日				4M						1M	0.485							
6日				5M						3M	0.506							
有担保コール(速報)				6M						6M	0.535							
O/N			0.430	1Y						1Y	0.618							

●入札結果

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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2025/8/21			8,549	3,255	0.008		0.010	52.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2025/8/21			9,363	3,254	0.008		0.008	89.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2025/8/21			9,873	3,500		0.008	0.008	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/8/20	2025/8/21	0.250	308	308		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/20	2025/8/21	0.250	0	0				

●2025年8月21日の予定

*ジャクソンホール会議(23日まで) *7月の米中古住宅販売件数	*流動性供給入札 (6,500億円、8/22発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、8/29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