

Central Daily Market Report

2025年8月21日(木)

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21日 需給速報	2025年8月22日 需給予想	2025年8月25日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 200	1,000			
財政	9,400	▲ 5,200	9,500			
資金過不足	9,100	▲ 5,400	10,500			
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	9,900					
CP等買入		▲ 100	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 600	200	600			
当預増減	18,500	▲ 5,000	10,500			
当座預金残高	5,240,700	5,235,700	5,246,200			
準備預金残高	4,792,800					
積み終了先	4,789,000			8月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,788,900			積数	16,000	
非準備預金先	447,900			1日平均	600	
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	99.61%	日数	19.35%		

●2025年8月21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>

21日のアウトライト市場は、1Y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

8/21	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	0.478	0.476	1W		0.590			T+0	0.493
T/N				2W	0.460	0.530	0.507		T+1	0.491
S/N				3W					1W	0.483
2日				1M	0.600	0.610	0.607		2W	0.482
3日				2M					3W	0.483
4日				3M			0.600		1M	0.485
5日				4M					3M	0.506
6日				5M				3M	0.440	
有担保コール(速報)				6M			6M	0.490	6M	0.539
O/N			0.430	1Y			1Y	0.690	1Y	0.633

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	
1.605	0.000	42,610.17	▲ 278.38	147.30-32	147.58-59	
日付		8/14	8/15	8/18	8/19	8/20
日銀当預残		5,146,600	5,229,700	5,228,200	5,225,700	5,222,200
準備預金残		4,702,300	4,781,000	4,780,800	4,778,500	4,773,300
マネタリーベース		6,366,700	6,449,100	6,447,400	6,444,300	6,441,500
無担O/N加重平均		0.477%	0.477%	0.477%	0.477%	0.476%
コール市場残高		116,576	114,353	112,935	113,891	115,683
うち無担		82,133	80,175	80,054	81,067	81,784
うちO/N		31,107	30,499	29,558	30,621	30,658
うち有担		34,443	34,178	32,881	32,824	33,899

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
流動性供給	435	-	6,500	2025/8/22	-	20,129	6,490		▲0.003%	63.2911%		▲0.009%		
交付税特会	-	-	10,500	2025/8/29	2026/2/27	44,697	10,500		0.655%	0.0317%		0.635%		

●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)		2025/8/21	2025/8/22	0.250	697	697		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/21	2025/8/22	0.250	0	0				

●2025年8月22日の予定

*7月の全国消費者物価指数	*国庫短期証券(1327回)入札
*6月のサービス産業動態統計速報	(3ヶ月、43,000億円、8/25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