

Central Daily Market Report

2025年8月27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27日 需給速報		2025年8月28日 需給予想		2025年8月29日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 200		▲ 500	
財政	▲ 2,100		▲ 2,500		4,500	
資金過不足	▲ 2,300		▲ 2,700		4,000	
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			8,800			
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	▲ 1,400	1,300		1,400		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 2,400		7,500		4,000	
当座預金残高	5,235,000		5,242,500		5,246,500	
準備預金残高	4,794,700					
積み終了先	4,794,100				8月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,794,000				積数	5,100
非準備預金先	440,300				1日平均	300
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	99.88%	日数	38.71%	

●2025年8月27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ており、出合いの水準は0.475～0.477%程度と横ばいで推移した。ターム物は、ショートターム物を中心に引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.485～0.490%程度での出合いとなった。
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＞

27日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数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

8/27	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	0.478	1W	0.484	0.530	0.499		T+0	0.488	1.625	+0.005	42,520.27	+125.87	147.47-50	147.75-77
T/N				2W	0.471	0.530	0.497		T+1	0.489						
S/N				3W												
2日				1M	0.535	0.560	0.552		1W	0.483						
3日				2M			0.560		2W	0.482						
4日				3M			0.600		3W	0.483						
5日				4M					1M	0.486						
6日			0.525	5M				3M	0.460	3M	0.524					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.490	6M	0.553					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.695	1Y	0.661					
日付																
		8/20	8/21	8/22	8/25	8/26										
日銀当預残		5,222,200	5,240,700	5,235,000	5,240,300	5,237,400										
準備預金残		4,773,300	4,792,800	4,801,500	4,797,800	4,791,800										
マネタリーベース		6,441,500	6,460,400	6,454,800	6,460,100	6,456,700										
無担O/N加重平均		0.476%	0.476%	0.476%	0.477%	0.478%										
コール市場残高		115,683	116,482	123,628	122,813	122,682										
うち無担		81,784	83,503	91,007	90,580	90,911										
うちO/N		30,658	31,517	40,571	38,794	39,305										
うち有担		33,899	32,979	32,621	32,233	31,771										

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2025/8/28			6,441	3,253	0.002		0.004	78.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2025/8/28			6,309	3,504	▲0.004		0.000	18.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,350	2025/8/28			2,800	1,353	▲0.003		0.004	66.3
国債買入(残存期間25年超)	750	2025/8/28			2,288	754	0.011		0.011	81.1
国債買入(物価連動債)	500	2025/8/28			1,479	500	▲0.060		▲0.224	80.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/8/27	2025/8/28	0.250	1,129	1,129		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/27	2025/8/28	0.250	398	398		0.250	0.250	

●2025年8月28日の予定

*中川審議委員 山口県金融経済懇談会における挨拶	*4-6月期の米GDP改定値	*2年利付国債入札(26,000億円、9/1発行) *交付税特別会計入札(9,950億円、9/10発行)
--------------------------	----------------	---

◆本資料は信頼できると思わ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