

Central Daily Market Report

2025年5月2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5月2日 需給速報	2025年5月7日 需給予想	2025年5月8日 当社予想		
銀行券	▲ 200	1,300	2,500		
財政	▲ 30,800	▲ 2,200	▲ 2,000		
資金過不足	▲ 31,000	▲ 900	500		
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					
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	▲ 2,100	1,300	2,100		
※ F T L 資金供給用国債補完供給					
当預増減	▲ 31,900	1,200	500		
当座預金残高	5,371,200	5,372,400	5,372,900		
準備預金残高	4,873,400				
積み終了先	4,873,300			5月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,873,200			積数	100
非準備預金先	497,800			1日平均	0
積み期間(4/16~5/15日)の所要準備額(積数)					3,965,500
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	70.00%	

●2025年5月2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なか、4連休前の取引となったことにより、一部の調達先でレート目線を引き上げる動きも散見されたため、出合いの水準は0.476~0.478%程度での推移となった。
ターム物はショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.49~0.495%程度での出合いとなった。
SC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>

2日はTDB3M物(第1303回)の入札が実施され、テールが流れる結果となったが、結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。
この他、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は一部の業態で発行が実施された。発行レートは0.5%以上で推移し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

5/2	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	0.477	1W	0.482	0.550	0.511	T+0	0.493	
T/N				2W				T+1	0.485	
S/N				3W				1W	0.454	
2日				1M			0.540	2W	0.454	
3日				2M				3W	0.452	
4日				3M	0.590	0.645	0.608	1M	0.454	
5日				4M				3M	0.465	
6日				5M				6M	0.489	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.576	
O/N			0.430	1Y						

JGB新発10年債		日経平均株価		為替(ドル/円)		
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時	
1.260	▲ 0.010	36,830.69	+378.39	145.40-42	145.13-15	
日付		4/24	4/25	4/28	4/30	5/1
日銀当預残	5,412,100	5,414,800	5,433,200	5,431,800	5,403,100	
準備預金残	4,915,600	4,895,700	4,904,100	4,889,100	4,895,100	
マネタリーベース	6,641,900	6,645,200	6,664,800	6,664,300	6,636,400	
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.476%	0.476%	0.477%	
コール市場残高	114,851	118,937	119,194	119,254	127,138	
うち無担	85,580	88,479	90,090	90,436	94,839	
うちO/N	33,534	36,523	38,414	39,560	44,433	
うち有担	29,271	30,458	29,104	28,818	32,299	

●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)	募入最価額	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非償額競争入札(億円)	非償額入札(億円)
国庫短期証券	1303	-	45,000	2025/5/7	2025/8/4	94,481	34,119.5	99.8965	0.4249%	44.0740%	99.9013	0.4051%	10,880	
流動性供給	429	-	5,000	2025/5/7	-	23,485	4,995		▲0.028%	65.3974%		▲0.028%		
交付税特会	-	-	11,000	2025/5/15	2025/11/14	48,828	11,000		0.600%	64.4235%		0.584%		

●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	応募総額(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)		2025/5/2	2025/5/7	0.250	2,188	2,188		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/5/2	2025/5/7	0.250	11	11		0.250	0.250	

●2025年5月5日の予定

* こどもの日
* 4月のISM非製造業景況指数
* London祝日(Early May bank holiday)

●2025年5月6日の予定

* 振替休日
* 米FOMC(1日目)
* 3月の米貿易収支

●2025年5月7日の予定

* 5月の日銀当座預金増減要因見込み
* 米FOMC(2日目)
* 3月の米消費者信用残高

◆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