

Central Daily Market Report

2025年8月25日(月)

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25日 需給速報	2025年8月26日 需給予想	2025年8月27日 当社予想	
銀行券	▲ 100	600	▲ 400	
財政	6,400	▲ 100	▲ 4,000	
資金過不足	6,300	500	▲ 4,400	
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		▲ 300	▲ 300	
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援				
社債等買入		▲ 400		
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 1,000	700	1,000	
当預増減	5,300	1,200	▲ 4,400	
当座預金残高	5,240,300	5,241,500	5,237,100	
準備預金残高	4,797,800			
積み終了先	4,796,100			
超過準備	4,795,900			
非準備預金先	442,500			
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	99.83%	日数	32.26%

●2025年8月25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。また、試し取りにより付利金利を上回る水準での出合いも一部見られた。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、0.485~0.495%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>

25日のアウトライイト市場は、3M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で発行が観測され、一部で大型発行も見られた。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

8/25	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	0.530	0.477	1W	0.560	0.610	0.601	T+0	0.493	
T/N				2W			0.480	T+1	0.493	
S/N				3W			0.535	1W	0.483	
2日				1M			0.525	2W	0.482	
3日				2M				3W	0.483	
4日				3M			0.700	1M	0.486	
5日				4M				3M	0.518	
6日				5M				6M	0.548	
有担保コール(速報)				6M			0.850	1Y	0.653	
O/N			0.430	1Y						

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	
1.615	+0.001	42,807.82	+174.53	147.26-28	147.33-35	
日付		8/18	8/19	8/20	8/21	8/22
日銀当預残		5,228,200	5,225,700	5,222,200	5,240,700	5,235,000
準備預金残		4,780,800	4,778,500	4,773,300	4,792,800	4,801,500
マネタリーベース		6,447,400	6,444,300	6,441,500	6,460,400	6,454,800
無担O/N加重平均		0.477%	0.477%	0.476%	0.476%	0.476%
コール市場残高		112,935	113,891	115,683	116,482	123,628
うち無担		80,054	81,067	81,784	83,503	91,007
うちO/N		29,558	30,621	30,658	31,517	40,571
うち有担		32,881	32,824	33,899	32,979	32,621

●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)		2025/8/25	2025/8/26	0.250	1,104	1,104		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/25	2025/8/26	0.250	0	0				

●2025年8月26日の予定

7月の企業向けサービス価格指数	*6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(3,500億円、8/27発行)
	*7月の米耐久財新規受注	*交付税特別会計入札(10,500億円、9/3発行)
	*8月の米CB消費者信頼感指数	

◆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ものがあります。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