

Central Daily Market Report

2025年7月18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7月18日 需給速報	2025年7月22日 需給予想	2025年7月23日 当社予想	
銀行券	▲ 300	▲ 300	500	
財政	▲ 300	12,600	▲ 2,000	
資金過不足	▲ 600	12,300	▲ 1,500	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出				
全店共通				▲ 8,000
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入		11,200		
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		▲ 500		
気候変動対応オペ	101,600	▲ 72,400		
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 1,200	1,600	1,200	
当預増減	28,500	24,600	▲ 9,500	
当座預金残高	5,216,500	5,241,100	5,231,600	
準備預金残高	4,732,800			
積み終了先	4,728,100			7月22日以降の残り所要積立額
超過準備	4,709,800			積数 21,800
非準備預金先	483,700			1日平均 900
積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(積数)				4,121,200
準備預金進捗率	実績 99.47%	日数 19.35%		

●2025年7月18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るなか週末4日積みを迎えたが、出合いの水準に大きな変化はなく、0.475~0.477%程度で推移した。ターム物は、1W~3M程度で引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.49~0.495%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＞

18日はTDB3M物(第1320回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、強含みで推移した。このほか、1Y物でも出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数の業態から発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

7/18	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	0.481	0.610	0.535	T+0	0.482	
T/N				2W				T+1	0.490	
S/N				3W				1W	0.481	
2日				1M				2W	0.481	
3日				2M				3W	0.481	
4日				3M			0.700	1M	0.481	
5日				4M				3M	0.488	
6日			0.630	5M				6M	0.502	
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(円)		為替(ドル/円)		
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時	
1.520	▲ 0.035	39,819.11	▲ 82.08	148.42-45	148.77-79	
日付		7/11	7/14	7/15	7/16	7/17
日銀当預残		5,190,600	5,183,800	5,185,900	5,181,000	5,188,000
準備預金残		4,717,700	4,709,200	4,716,100	4,709,900	4,722,700
マネタリーベース		6,408,700	6,401,200	6,402,700	6,397,800	6,405,400
無担O/N加重平均		0.477%	0.479%	0.476%	0.477%	0.477%
コール市場残高		114,700	114,248	115,054	112,787	114,042
うち無担		84,772	84,368	85,195	82,562	83,547
うちO/N		31,530	32,476	32,533	31,130	30,355
うち有担		29,928	29,880	29,859	30,225	30,495

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1320	-	43,000	2025/7/22	2025/10/20	112,298.5	32,728.4	99.8995	0.4079%	2.9322%	99.9013	0.4006%	10,271	

●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	2025/7/22			6,268	3,255	▲0.005		▲0.003	49.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2025/7/22			5,720	3,252	▲0.017		▲0.012	69.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2025/7/22			5,555	3,500		▲0.026	▲0.016	
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,350	2025/7/22			2,307	1,351	▲0.039		▲0.027	88.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/7/18	2025/7/22	0.250	1,402	1,402		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/7/18	2025/7/22	0.250	0	0				

●2025年7月21日の予定

*海の日

●2025年7月22日の予定

*特にありません

◆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