

Central Daily Market Report

2025年9月19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9月19日 需給速報		2025年9月22日 需給予想		2025年9月24日 当社予想					
銀行券	300		100		▲ 500					
財政	▲ 400		54,600		▲ 3,000					
資金過不足	▲ 100		54,700		▲ 3,500					
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										
CP等買入		▲ 200		▲ 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		▲ 300		▲ 100						
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 1,200	2,800		1,200						
※ドル資金供給利用国債提供供給										
当預増減	1,000		55,700		▲ 3,500					
当座預金残高	4,985,600		5,041,300		5,037,800					
準備預金残高	4,545,100		<div>9月22日以降の残り所要積立額</div> <table><tr><td>積数</td><td>20,500</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>900</td></tr></table>				積数	20,500	1日平均	900
積数	20,500									
1日平均	900									
積み終了先	4,541,300									
超過準備	4,534,600									
非準備預金先	440,500									
積み期間（9/16～10/15日）の所要準備額（積数）							3,983,200			
準備預金進捗率	実績		99.49%	日数	20.00%					

●短期金融市場関連指標

9/19	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			0.520			T+0	0.487
T/N				2W	0.460	0.560	0.481			T+1	0.493
S/N				3W							
2日				1M			0.540			1W	0.482
3日				2M						2W	0.480
4日			0.630	3M			0.700			3W	0.481
5日				4M			0.800			1M	0.482
6日			0.610	5M				3M	0.523		
有担保コール(速報)				6M				6M	0.480	6M	0.570
O/N			0.430	1Y				1Y	0.730	1Y	0.692

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
1.640	+0.045	45,045.81	▲ 257.62	147.95~96	147.92~95

日付	9/11	9/12	9/16	9/17	9/18
日銀当預残	5,109,500	4,989,200	4,988,600	4,986,000	4,984,600
準備預金残	4,674,000	4,570,900	4,563,400	4,541,700	4,554,400
マネタリーベース	6,325,900	6,205,200	6,204,300	6,201,100	6,199,800
無担O/N加重平均	0.480%	0.477%	0.477%	0.478%	0.477%
コール市場残高	119,790	118,854	117,870	107,719	108,484
うち無担	88,472	87,313	86,427	81,610	82,005
うちO/N	35,016	35,337	34,891	31,868	31,913
うち有担	31,318	31,541	31,443	26,109	26,479

●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 平均償倍	募入 平均利回	第Ⅰ非償倍 競争入札(億 円)	第Ⅱ非 償倍競争入 札(億円)
<p>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。</p>														

●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)		2025/9/19	2025/9/22	0.250	926	926		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/9/19	2025/9/22	0.250	300	300		0.250	0.250	

当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した(賛成7反対2)。無担保コールレート(オーバーナイト物)を、0.5%程度で推移するよう促す。
2. 日本銀行が保有するETFおよびJ-REITについて、市場に攪乱的な影響を与えることを回避する等の基本方針を踏まえ、「金融機関から買入れた株式」の売却と同程度の規模で、市場への売却を行うことを決定した(全員一致)。

●2025年9月22日の予定

*特にありません

- ◆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。

引法に基づきお渡しする書面や目論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