

Central Daily Market Report

2025年10月20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10月20日 需給速報 | 2025年10月21日 需給予想 | 2025年10月22日 当社予想 |
|------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 銀行券 | ▲ 600 | ▲ 100 | ▲ 1,000 |
| 財政 | ▲ 7,000 | 100 | ▲ 3,500 |
| 資金過不足 | ▲ 7,600 | 0 | ▲ 4,500 |
| 金融調節 | スタート | エンド | スタート |
| 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 | | | |
| 貸出支援基金(成) | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | |
| 被災地支援 | | | |
| 社債等買入 | | ▲ 100 | |
| 気候変動対応オペ | | | |
| E T F 買入 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 2,000 | 1,400 | 2,000 |
| ※ドル資金供給用担保回債供給 | | | |
| 当預増減 | ▲ 8,200 | 1,900 | ▲ 4,500 |
| 当座預金残高 | 4,965,900 | 4,967,800 | 4,963,300 |
| 準備預金残高 | 4,513,400 | | |
| 積み終了先 | 4,507,100 | 10月21日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 4,500,900 | 積数 | 17,700 |
| 非準備預金先 | 452,500 | 1日平均 | 700 |
| 積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(積数) | 4,104,100 | | |
| 準備預金進捗率 | 実績 99.57% | 日数 16.13% | |

●短期金融市場関連指標

| 10/20 | 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 |
| O/N | 0.450 | 0.530 | 0.477 | 1W | | | 0.590 | | T+0 0.499 | 1.665 | +0.040 | 49,185.50 | +1,603.35 | 150.91-93 | 150.74-76 |
| T/N | | | | 2W | 0.471 | 0.475 | 0.473 | | T+1 0.499 | | | | | | |
| S/N | | | | 3W | | | | | | | | | | | |
| 2日 | | | | 1M | | | | | | | | | | | |
| 3日 | | | | 2M | | | | | | | | | | | |
| 4日 | | | | 3M | | | 0.630 | | | | | | | | |
| 5日 | | | | 4M | | | | | | | | | | | |
| 6日 | | | | 5M | | | | | | | | | | | |
| 有担保コール(速報) | | | | 6M | | | | | | | | | | | |
| O/N | | | 0.430 | 1Y | | | | | 3M 0.440 | 3M 0.550 | 107,119 | 104,959 | 106,468 | 108,288 | 107,509 |
| | | | | | | | | | 6M 0.560 | 6M 0.614 | うち無担 80,152 | 78,189 | 80,027 | 81,670 | 80,517 |
| | | | | | | | | | 1Y 0.730 | 1Y 0.720 | うちO/N 28,624 | 27,187 | 27,115 | 28,118 | 26,780 |
| | | | | | | | | | | | うち有担 26,967 | 26,770 | 26,441 | 26,618 | 26,992 |

●入札結果

| 名稱 | 回号 | 表面 利回り | 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 | 棄分率 | 募入 平均価格 | 募入 平均利回 | 第I 非価格 競争入札(億円) | 第I 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 | 貸付利回り (%) | 利回り (%)※1 | 応札総額 (億円・ 百万ドル) | 落札総額 (億円・ 百万ドル) | 投分レート ・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 | 投分 比率 |
|--------------------------|------------------------|------------|------------|--------------|--------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|----------|
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー) | | 2025/10/20 | 2025/10/21 | | 0.250 | 2,233 | 2,233 | | | 0.250 | 0.250 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー) | | 2025/10/20 | 2025/10/21 | | 0.250 | 0 | 0 | | | | |

●2025年10月21日の予定

| |
|-----------------------------------|
| *GX10年利付国債入札 (3,000億円、10/22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