

Central Daily Market Report

2025年9月22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9月22日 需給速報	2025年9月24日 需給予想	2025年9月25日 当社予想			
銀行券	0	200	▲ 1,000			
財政	53,800	▲ 7,700	▲ 3,000			
資金過不足	53,800	▲ 7,500	▲ 4,000			
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		▲ 100	▲ 500			
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	▲ 200			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 1,500	1,200	1,500			
当預増減	53,300	▲ 6,700	▲ 4,000			
当座預金残高	5,038,900	5,032,200	5,028,200			
準備預金残高	4,598,000					
積み終了先	4,594,400			9月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,594,100			積数	12.700	
非準備預金先	440,900			1日平均	600	
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	99.68%	日数	26.67%		

●2025年9月22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、出合いの水準は0.475~0.478%程度で推移した。ターム物では、オファーサイドの一部に10月会合を越えるターム物のレート目線を引き上げる動きが見られたものの、ビッドサイドからの追従がなかったことから、1W~3W程度のショートタームでの出合いが中心となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、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>

22日のアウトライイト市場は、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。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

9/22	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	最低	最高	平均	直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時			
O/N	0.450	0.478	0.476	1W		0.520				T+0	0.488	1.654	+0.014	45,493.66	+447.85	148.10-12	148.11-13	
T/N				2W	0.470	0.481	0.476			T+1	0.492							
S/N				3W														
2日				1M						1W	0.480							
3日				2M						2W	0.479							
4日				3M	0.610	0.650	0.629			3W	0.481							
5日				4M						1M	0.481							
6日			0.560	5M						3M	0.532							
有担保コール(速報)				6M						6M	0.576							
O/N			0.430	1Y						1Y	0.697							

日付	9/12	9/16	9/17	9/18	9/19
日銀当預残	4,989,200	4,988,600	4,986,000	4,984,600	4,985,600
準備預金残	4,570,900	4,563,400	4,541,700	4,554,400	4,545,100
マネタリーベース	6,205,200	6,204,300	6,201,100	6,199,800	6,200,600
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.478%	0.477%	0.477%
コール市場残高	118,854	117,870	107,719	108,484	105,017
うち無担	87,313	86,427	81,610	82,005	78,335
うちO/N	35,337	34,891	31,868	31,913	30,913
うち有担	31,541	31,443	26,109	26,479	26,682

●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)		2025/9/22	2025/9/24	0.250	1,606	1,606		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/9/22	2025/9/24	0.250	0	0				

●2025年9月23日の予定

*秋分の日	*8月の米中古住宅販売件数
-------	---------------

●2025年9月24日の予定

*7月のサービス産業動態統計速報	*8月の米新築一戸建て販売件数
------------------	-----------------

◆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