

Central Daily Market Report

2025年10月27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27日 需給速報	2025年10月28日 需給予想	2025年10月29日 当社予想
銀行券	0	0	▲ 500
財政	▲ 3,400	▲ 1,200	▲ 2,000
資金過不足	▲ 3,400	▲ 1,200	▲ 2,500

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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 1,000				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 1,400	900		1,400		
当預増減	▲ 5,100		200		▲ 10,500	

当座預金残高	4,978,000	4,978,200	4,967,700	
準備預金残高	4,535,200			
積み終了先	4,533,900	10月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,533,800	積数	2,000	
非準備預金先	442,800	1日平均	100	
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	99.95%	日数	38.71%

●2025年10月27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たことで、出合いの水準は0.475~0.478%程度で推移した。ターム物は、ショートターム物で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.50~0.505%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>

27日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

10/27	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	売買取統計値			平均値	
O/N	0.450	0.525	0.477	1W	0.550	0.560	0.552	T+0	0.497		
T/N				2W	0.471	0.481	0.476	T+1	0.499		
S/N				3W							
2日				1M				1W	0.491		
3日			0.630	2M				2W	0.491		
4日				3M				3W	0.491		
5日				4M				1M	0.495		
6日				5M				3M	0.562		
有担保コール(速報)				6M				6M	0.560		
O/N			0.430	1Y				1Y	0.732		

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	
1.670	+0.015	50,512.32	+1,212.67	153.07-09	153.02-04	
日付	10/20	10/21	10/22	10/23	10/24	
日銀当預残	4,965,900	4,962,700	4,965,400	4,976,700	4,983,100	
準備預金残	4,513,600	4,505,600	4,519,300	4,537,300	4,536,600	
マネタリーベース	6,178,600	6,175,500	6,178,300	6,190,500	6,197,600	
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%	
コール市場残高	109,989	110,548	107,695	108,184	107,392	
うち無担	83,013	83,741	81,031	81,330	80,689	
うちO/N	29,106	29,089	28,329	27,987	27,096	
うち有担	26,976	26,807	26,664	26,854	26,703	

●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	貸付利率(%)	利回り(%)※1	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)		2025/10/27	2025/10/28	0.250		1,365	1,365		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/10/27	2025/10/28	0.250		100	100		0.250	0.250	

●2025年10月28日の予定

*米FOMC(1日目)	*8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*10月の米CB消費者信頼感指数
-------------	-----------------------	------------------

◆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。
◆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