

Central Daily Market Report

2025年11月18日(火)

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11月18日 需給速報	2025年11月19日 需給予想	2025年11月20日 当社予想	
銀行券	300	▲ 600	▲ 1,000	
財政	▲ 9,800	▲ 4,800	▲ 8,000	
資金過不足	▲ 9,500	▲ 5,400	▲ 9,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出	エンド	エンド	エンド	
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				
気候変動対応オペ				
国債補完供給	▲ 200	500	200	
* 下ドル資金供給用担保国債供給				
当預増減	▲ 9,200	▲ 5,200	▲ 9,000	
当座預金残高	4,892,700	4,887,500	4,878,500	
準備預金残高	4,479,400			
積み終了先	4,433,700			
超過準備	4,407,300			
非準備預金先	413,300			
積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(積数)			3,979,900	
準備預金進捗率	実績	98.04%	日数	10.00%

●2025年11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、出合いの水準は0.477~0.478%程度で推移した。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.500~0.505%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>

18日のアウトライト市場は、3M物、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部の業態で大型発行も見られた。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

11/18	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	17時		
O/N	0.450	0.525	0.478	1W	0.485	0.545	0.504	T+0	0.494	1.745	+0.015	48,702.98	▲ 1,620.93	155.28-29	154.99-01	
T/N				2W	0.470	0.600	0.491	T+1	0.498							
S/N				3W												
2日				1M				1W	0.492							
3日				2M				2W	0.491							
4日				3M				3W	0.491							
5日				4M				1M	0.495							
6日				5M				3M	0.576							
有担保コール(速報)				6M			0.750	6M	0.632							
O/N			0.430	1Y				1Y	0.743							

日付	11/11	11/12	11/13	11/14	11/17
日銀当預残	4,925,700	4,925,900	4,931,400	4,903,600	4,901,900
準備預金残	4,498,800	4,497,000	4,505,100	4,489,200	4,493,100
マネタリーベース	6,137,900	6,137,700	6,143,400	6,115,100	6,113,600
無担O/N加重平均	0.477%	0.479%	0.477%	0.478%	0.477%
コール市場残高	110,886	114,443	109,953	110,926	110,905
うち無担	82,695	86,227	83,634	84,288	82,647
うちO/N	30,298	32,320	29,107	29,961	29,820
うち有担	28,191	28,216	26,319	26,638	28,258

●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)
交付税特会	-	-	13,000	2025/11/26	2026/5/27	36,445	13,000		0.752%	36.5460%		0.739%		-

●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
米ドル資金供給		2025/11/20	2025/11/28	4.140		2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/11/18	2025/11/19		0.250	75	75		0.250	0.237	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/11/18	2025/11/19		0.250	154	154		0.250	0.250	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2025/11/19	2025/12/1		0.470	2	2		0.470	0.470	

●2025年11月19日の予定

*10月の貿易統計	*10月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1345回)入札(1年、32,000億円、11/20発行)
*9月の石油等消費動態統計	*10月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*20年利付国債入札(8,000億円、11/20発行)
*9月の機械受注統計	*10月の英消費者物価指数	

◆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。
◆金融商品の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