

Central Daily Market Report

2025年8月29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8月29日 需給速報	2025年9月1日 需給予想	2025年9月2日 当社予想		
銀行券	200	600	1,200		
財政	▲ 3,500	▲ 19,900	▲ 29,000		
資金過不足	▲ 3,300	▲ 19,300	▲ 27,800		
金融調節	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					
貸出支援基金(成)			▲ 2,400		
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	▲ 800	800	800		
当預増減	▲ 3,400	▲ 20,900	▲ 27,800		
当座預金残高	5,236,700	5,215,800	5,188,000		
準備預金残高	4,767,800				
積み終了先	4,767,200			9月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,767,100			積数	2,500
非準備預金先	468,900			1日平均	200
積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(積数)					4,108,500
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	51.61%	

●2025年8月29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、月末要因により一部で調達を見合わせる動きが見られたが、相場への影響は限定的であった事から、出会いの水準は0.475~0.477%程度と横ばいで推移した。ターム物はショートターム物を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.495%程度での出会いとなった。SCI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>

29日はTDB3M物(第1328回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

8/29	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	0.550	0.590	0.566	T+0	0.455	
T/N				2W			0.680	T+1	0.490	
S/N				3W			0.482	1W	0.482	
2日				1M			0.580	2W	0.482	
3日				2M			0.595	3W	0.482	
4日				3M				1M	0.485	
5日				4M				3M	0.529	
6日				5M				6M	0.568	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.671	
O/N			0.430	1Y						

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
1.600	▲ 0.015	42,718.47	▲ 110.32	146.82-84	147.00-02
日付					
	8/22	8/25	8/26	8/27	8/28
日銀当預残	5,235,000	5,240,300	5,237,400	5,235,000	5,240,100
準備預金残	4,801,500	4,797,800	4,791,800	4,794,700	4,798,800
マネタリーベース	6,454,800	6,460,100	6,456,700	6,454,600	6,459,800
無担O/N加重平均	0.476%	0.477%	0.478%	0.478%	0.478%
コール市場残高	123,628	122,813	122,682	119,961	122,002
うち無担	91,007	90,580	90,911	88,303	90,615
うちO/N	40,571	38,794	39,305	35,977	37,269
うち有担	32,621	32,233	31,771	31,658	31,387

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1328	-	43,000	2025/9/1	2025/12/1	115,881.5	33,580.8	99.8800	0.4818%	93.3338%	99.8819	0.4742%	9,419	

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/8/29	2025/9/1	0.150	904	904		0.150	0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/29	2025/9/1	0.150	0	0				

●2025年9月1日の予定

*4-6月期の法人企業統計調査季報	*New York祝日(Labor Day)
-------------------	------------------------

◆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