

Central Daily Market Report

2025年9月4日(木)

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4日 需給速報	2025年9月5日 需給予想	2025年9月8日 当社予想	
銀行券	200	900	1,500	
財政	3,700	▲ 7,300	▲ 3,000	
資金過不足	3,900	▲ 6,400	▲ 1,500	
金融調節	スタート	スタート	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	8,300			
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	▲ 1,600	1,200	1,600	
当預増減	11,700	▲ 4,800	▲ 1,500	
当座預金残高	5,165,400	5,160,600	5,159,100	
準備預金残高	4,737,000			
積み終了先	4,736,600			
超過準備	4,736,600			
非準備預金先	428,400			
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	99.99%	日数	64.52%

●2025年9月4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、0.485~0.495%程度での出合いとなった。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>

4日のアウトライト市場は、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で発行が実施された。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

9/4	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	0.525	0.479	1W					T+0	0.487
T/N				2W	0.460	0.470	0.465		T+1	0.485
S/N				3W					1W	0.482
2日				1M	0.550	0.620	0.585		2W	0.482
3日				2M					3W	0.481
4日				3M					1M	0.484
5日				4M					3M	0.531
6日				5M					6M	0.568
有担保コール(速報)				6M			0.465		1Y	0.671
O/N			0.430	1Y			0.685			

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	▲ 0.030	42,580.27	+641.38	147.96-98	148.37-38
日付					
8/28	8/29	9/1	9/2	9/3	
日銀当預残	5,240,100	5,236,700	5,211,000	5,185,500	5,153,700
準備預金残	4,798,800	4,767,800	4,765,200	4,742,600	4,717,400
マネタリーベース	6,459,800	6,456,300	6,430,000	6,404,200	6,372,600
無担O/N加重平均	0.478%	0.477%	0.477%	0.478%	0.478%
コール市場残高	122,002	120,379	120,620	120,881	121,033
うち無担	90,615	89,643	89,688	90,247	91,051
うちO/N	37,269	39,457	38,912	39,291	38,335
うち有担	31,387	30,736	30,932	30,634	29,982

●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)
30年利付国債	87	2.8%	7,000	2025/9/5	2055/6/20	17,552	5,306	92.80	3.277%	5.2264%	92.98	3.264%	1,689	

●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)		2025/9/4	2025/9/5	0.250	1,735	1,735		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/9/4	2025/9/5	0.250	0	0				

●2025年9月5日の予定

*7月の毎月勤労統計調査速報 *7月の全世帯家計調査 *8月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *7月の景気動向指数速報	*8月の米雇用統計 *4-6月期のユーロ圏GDP確報値	*国庫短期証券(1329回)入札 (3ヶ月、43,000億円、9/8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