

# Central Daily Market Report

2025年9月5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9月5日 需給速報	2025年9月8日 需給予想	2025年9月9日 当社予想		
銀行券	1,000	400	1,000		
財政	▲ 4,500	▲ 6,600	▲ 8,500		
資金過不足	▲ 3,500	▲ 6,200	▲ 7,500		
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)					
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					
E T F 買入					
国債補完供給	▲ 200	1,300	200		
当預増減	▲ 2,400	▲ 6,000	▲ 7,500		
当座預金残高	5,163,000	5,157,000	5,149,500		
準備預金残高	4,731,400				
積み終了先	4,731,400			9月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,731,300			積数	100
非準備預金先	431,600			1日平均	0
積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(積数)					4,113,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	74.19%	

## ●2025年9月5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、週末を迎えたが相場に大きな変化はなく、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から、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、0.490~0.495%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>

5日はTDB3M物(第1329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は、堅調に推移した。このほか、1Y物でも出合いが見られた。

### <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推移した。

## ●短期金融市場関連指標

9/5	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	0.440	0.478	0.477	1W				T+0	0.490	
T/N				2W		0.590		T+1	0.491	
S/N				3W	0.471	0.481	0.476			
2日				1M				1W	0.482	
3日				2M				2W	0.482	
4日				3M			0.700	3W	0.481	
5日				4M				1M	0.484	
6日				5M				3M	0.530	
有担保コール(速報)				6M			6M	0.500	6M	0.568
O/N			0.430	1Y			1Y	0.680	1Y	0.672

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
1.570	▲ 0.030	43,018.75	+438.48	148.42-43	148.21-23
日付					
	8/29	9/1	9/2	9/3	9/4
日銀当預残	5,236,700	5,211,000	5,185,500	5,153,700	5,165,400
準備預金残	4,767,800	4,765,200	4,742,600	4,717,400	4,737,000
マネタリーベース	6,456,300	6,430,000	6,404,200	6,372,600	6,384,100
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.478%	0.478%	0.479%
コール市場残高	120,379	120,620	120,881	121,033	123,378
うち無担	89,643	89,688	90,247	91,051	92,849
うちO/N	39,457	38,912	39,291	38,335	39,633
うち有担	30,736	30,932	30,634	29,982	30,529

## ●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非償格額(億円)	非償格額(億円)
国庫短期証券	1329	-	43,000	2025/9/8	2025/12/8	101,094	33,503.6	99,8845	0.4638%	47.2346%	99.8874	0.4521%	9,496	

## ●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)		2025/9/5	2025/9/8	0.250	262	262		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/9/5	2025/9/8	0.250	0	0				

## ●2025年9月8日の予定

*4-6月期のGDP 2次速報 *7月の国際収支 *8月の景気ウォッチャー調査	*7月の米消費者信用残高	*流動性供給入札 (6,000億円、9/9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