

Central Daily Market Report

2025年9月10日(水)

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10日 需給速報	2025年9月11日 需給予想	2025年9月12日 当社予想			
銀行券	400	▲ 100	▲ 600			
財政	▲ 16,600	▲ 25,100	1,000			
資金過不足	▲ 16,200	▲ 25,200	400			
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						
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)					10,700	▲ 149,100
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	▲ 2,700	1,500		2,700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 17,500	▲ 22,500			▲ 138,000	
当座預金残高	5,135,100	5,112,600			4,974,600	
準備預金残高	4,695,600					
積み終了先	4,695,500					
超過準備	4,695,500					
非準備預金先	439,500					
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	83.87%		

●2025年9月10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、0.49~0.495%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>

10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、複数の業態で発行が実施された。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

9/10	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	0.477	1W		0.484		T+0	0.489	
T/N				2W		0.475		T+1	0.491	
S/N				3W				1W	0.482	
2日				1M		0.550		2W	0.482	
3日				2M				3W	0.481	
4日				3M	0.600	0.630	0.620	1M	0.484	
5日			0.560	4M				3M	0.525	
6日	0.480	0.481	0.481	5M				6M	0.569	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.670	
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
1.565	+0.005	43,837.67	+378.38	147.39-40	147.50-51
日付	9/3	9/4	9/5	9/8	9/9
日銀当預残	5,153,700	5,165,400	5,163,000	5,159,600	5,152,600
準備預金残	4,717,400	4,737,000	4,731,400	4,731,800	4,717,100
マネタリーベース	6,372,600	6,384,100	6,380,700	6,376,900	6,369,200
無担O/N加重平均	0.478%	0.479%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	121,033	123,378	117,691	118,080	117,327
うち無担	91,051	92,849	87,342	87,252	86,791
うちO/N	38,335	39,633	35,476	34,786	34,375
うち有担	29,982	30,529	30,349	30,828	30,536

●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)
5年利付国債	180	1.1%	24,000	2025/9/11	2030/6/20	70,060	18,955	99.88	1.126%	80.4302%	99.91	1.119%	5,041	0.66

●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)		2025/9/10	2025/9/11	0.250	2,812	2,812		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/9/10	2025/9/11	0.250	100	100		0.250	0.250	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
貸出増加支援オペ	貸付期間1年	2025/9/12	2026/9/14	変動※	10,693					

●2025年9月11日の予定

*8月の企業物価指数 *7-9月期の法人企業景気予測調査季報	*ECB定例理事会 *8月の米消費者物価指数 *8月の米財政収支	*エネルギー対策特別会計借入 (6,613億円、9/22借入)
-----------------------------------	--	------------------------------------

◆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