

# Central Daily Market Report

2025年9月11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11日 需給速報	2025年9月12日 需給予想	2025年9月16日 当社予想			
銀行券	▲ 100	300	1,500			
財政	▲ 25,800	9,000	▲ 10,000			
資金過不足	▲ 25,900	9,300	▲ 8,500			
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			8,400			
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			10,700	▲ 144,900		
被災地支援						
社債等買入				▲ 400		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 2,400	2,700		2,400		
当預増減	▲ 25,600	▲ 114,500	▲ 8,500			
当座預金残高	5,109,500	4,995,000	4,986,500			
準備預金残高	4,674,000					
積み終了先	4,674,000			9月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,674,000			積数	0	
非準備預金先	435,500			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	87.10%		

## ●2025年9月11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。また、試し取りにより付利金利を上回る水準での出合いも一部見られた。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、0.49~0.505%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＞

11日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態で発行が実施され、一部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

9/11	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	0.480	1W					T+0	0.489	1.575	+0.010	44,372.50	+534.83	147.35-37	147.77-78
T/N				2W					T+1	0.489						
S/N				3W												
2日				1M		0.580			1W	0.482						
3日				2M					2W	0.482						
4日				3M					3W	0.481						
5日				4M					1M	0.483						
6日				5M				3M	0.430	3M	0.524					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.470	6M	0.571					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.690	1Y	0.673					

日付	9/4	9/5	9/8	9/9	9/10
日銀当預残	5,165,400	5,163,000	5,159,600	5,152,600	5,135,100
準備預金残	4,737,000	4,731,400	4,731,800	4,717,100	4,695,600
マネタリーベース	6,384,100	6,380,700	6,376,900	6,369,200	6,351,300
無担O/N加重平均	0.479%	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	123,378	117,691	118,080	117,327	115,949
うち無担	92,849	87,342	87,252	86,791	85,009
うちO/N	39,633	35,476	34,786	34,375	32,573
うち有担	30,529	30,349	30,828	30,536	30,940

## ●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)
エネルギー対策	-	-	6,613	2025/9/22	2026/9/24	27,356	6,613		0.800%	33.0000%		0.763%		

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2025/9/12			9,892	3,253	0.001		0.005	26.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2025/9/12			7,599	3,501	▲0.001		0.002	20.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,350	2025/9/12			3,980	1,354	▲0.002		0.000	40.6
国債買入(残存期間25年超)	750	2025/9/12			2,183	751	▲0.008		▲0.003	84.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/9/11	2025/9/12	0.250	2,162	2,162		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/9/11	2025/9/12	0.250	360	360		0.250	0.250	

## ●2025年9月12日の予定

*9月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券入札 (3ヶ月、43,000億円、9/16借入)
	*流動性供給入札 (6,500億円、9/16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ことがあります。金融商品取引法に基づきお渡り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