

Central Daily Market Report

2025年10月1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10月1日 需給速報		2025年10月2日 需給予想		2025年10月3日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		0		▲ 500	
財政	▲ 29,300		▲ 49,000		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 30,700		▲ 49,000		▲ 26,500	
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	8,000	▲ 8,000				
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	▲ 4,700	2,100		4,700		
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	▲ 33,300		▲ 44,300		▲ 26,500	
当座預金残高	4,987,900		4,943,600		4,917,100	
準備預金残高	4,542,600					
積み終了先	4,542,500				10月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,542,500				積数 500	
非準備預金先	445,300				1日平均 0	
積み期間（9/16～10/15日）の所要準備額（積数）					3,983,200	
準備預金進捗率	実績 99.99%		日数 53.33%			

●2025年10月1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、四半期末要因が剥落したこともあり、国内勢を中心に資金調達ニーズが見られ、出会いの水準は0.475～0.478%程度で推移した。
ターム物は、ショートタームを中心に引き合いが散見された。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.495%度での出会いとなった。
SC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＞
1日のアウトライト市場は、特段の出会いは見られなかった。

＜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

10/1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	0.530	0.477	1W	0.484	0.600	0.524			T+0	0.494	1.645	0.000	44,550.85	▲ 381.78	148.02-03	147.11-12
T/N				2W			0.470			T+1	0.493						
S/N				3W			0.490										
2日				1M	0.535	0.640	0.560			1W	0.483						
3日				2M						2W	0.482						
4日				3M					3W	0.482							
5日				4M					1M	0.484							
6日	0.481	0.510	0.490	5M			0.850	3M	0.450	3M	0.565						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.480	6M	0.608						
O/N			0.430	1Y				1Y	0.760	1Y	0.719						

日付		9/24	9/25	9/26	9/29	9/30
日銀当預残		5,035,200	5,048,600	5,039,400	5,032,100	5,021,200
準備預金残		4,599,600	4,620,300	4,601,600	4,589,600	4,549,600
マネタリーベース		6,249,900	6,263,200	6,253,300	6,245,800	6,233,700
無担O/N加重平均		0.478%	0.477%	0.476%	0.477%	0.477%
コール市場残高		112,406	108,471	108,068	106,043	100,197
うち無担		84,167	81,003	81,513	79,988	75,970
うちO/N		31,707	28,193	28,493	27,741	26,968
うち有担		28,239	27,468	26,555	26,055	24,227

●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)
交付税特会	-	-	13,000	2025/10/10	2026/4/10	44,492	13,000.03		0.735%	19.9400%		0.712%		-

●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)		2025/10/1	2025/10/2	0.250	4,161	4,161		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/10/1	2025/10/2	0.250	800	800		0.250	0.250	

●2025年10月2日の予定

* 内田日銀副総裁 全国証券大会における挨拶 *9月のマネタリーベース *9月の消費動向調査 *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*8月の米製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札 (26,000億円、10/3発行)
--	--------------------	---------------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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論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