

Central Daily Market Report

2025年9月29日(月)
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29日 需給速報	2025年9月30日 需給予想	2025年10月1日 当社予想			
銀行券	300	1,000	500			
財政	▲ 6,700	▲ 11,300	▲ 25,200			
資金過不足	▲ 6,400	▲ 10,300	▲ 24,700			
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			7,700			
CP等買入		▲ 100	▲ 200			
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						
国債補充供給	▲ 1,800	1,000	1,800			
当増減	▲ 7,300	▲ 1,000	▲ 32,700			
当座預金残高	5,032,100	5,031,100	4,998,400			
準備預金残高	4,590,700					
積み終了先	4,590,600			9月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,590,200			積数	600	
非準備預金先	441,400			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	99.98%	日数	46.67%		

●2025年9月29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、前週に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、ショートタームを中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.29~0.38%程度での出合いとなった。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>

29日のアウトライト市場は、3M物で出合いが見られた。

<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あった。

●短期金融市場関連指標

9/29	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
	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	0.478	0.477	1W	0.475	0.590	0.524	T+0	0.489	
T/N			0.550	2W	0.481	0.545	0.514	T+1	0.380	
S/N				3W						
2日				1M	0.550	0.560	0.551	1W	0.468	
3日				2M				2W	0.476	
4日				3M				3W	0.479	
5日				4M				1M	0.480	
6日				5M				3M	0.552	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.594	
O/N			0.430	1Y				1Y	0.711	

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	
1.640	▲ 0.015	45,043.75	▲ 311.24	149.41-42	148.56-58	
日付		9/19	9/22	9/24	9/25	9/26
日銀当預残	4,985,600	5,038,900	5,035,200	5,048,600	5,039,400	
準備預金残	4,545,100	4,598,000	4,599,600	4,620,300	4,601,600	
マネタリーベース	6,200,600	6,253,900	6,249,900	6,263,200	6,253,300	
無担O/N加重平均	0.477%	0.476%	0.478%	0.477%	0.476%	
コール市場残高	105,017	108,073	112,406	108,471	108,068	
うち無担	78,335	79,905	84,167	81,003	81,513	
うちO/N	30,913	32,199	31,707	28,193	28,493	
うち有担	26,682	28,168	28,239	27,468	26,555	

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。														

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2025/9/30			6,973	3,257	▲0.014		▲0.012	18.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2025/9/30			4,829	3,504	▲0.019		▲0.015	66.2
国債買入(残存期間25年超)	750	2025/9/30			1,606	751	▲0.030		▲0.023	23.2
国債買入(物価連動債)	500	2025/9/30			1,991	500	▲0.020		▲0.143	85.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/9/29	2025/9/30	0.250	1,923	1,923		0.250	0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/9/29	2025/9/30	0.250	0	0				

●2025年9月30日の予定

*決定会合における主な意見(9月18,19日分)	*9月のシカゴPM景況感指数	*2年利付国債入札(27,000億円、10/1発行)
*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*9月の米CB消費者信頼感指数	
*8月の商業動態統計速報	*7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
*8月の住宅着工統計	*4-6月期の英GDP確報値	

◆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