

Central Daily Market Report

2025年10月7日(火)
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7日 需給速報	2025年10月8日 需給予想	2025年10月9日 当社予想			
銀行券	600	200	▲ 500			
財政	900	▲ 11,000	3,000			
資金過不足	1,500	▲ 10,800	2,500			
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						
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		▲ 100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 2,900	1,000	2,900			
当増減	▲ 500	▲ 7,900	2,500			
当座預金残高	4,931,100	4,923,200	4,925,700			
準備預金残高	4,474,300					
積み終了先	4,474,300			10月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,474,300			積数	100	
非準備預金先	456,800			1日平均	0	
積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(積数)					3,978,100	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	73.33%		

●2025年10月7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資金調達ニーズが見られ、出合いの水準は0.475~0.478%と横ばい圏での推移となった。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%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>

7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

10/7	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	0.530	0.477	1W	0.485	0.510	0.489	T+0	0.489	
T/N				2W	0.460	0.481	0.470	T+1	0.492	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.483	
3日				2M				2W	0.483	
4日				3M		0.610		3W	0.482	
5日				4M				1M	0.490	
6日				5M				3M	0.552	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.606	
O/N			0.430	1Y				1Y	0.710	

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
1.675	+0.005	47,950.88	+6.12	150.36-38	150.62-64
日付	9/30	10/1	10/2	10/3	10/6
日銀当預残	5,021,200	4,987,900	4,948,400	4,924,700	4,931,600
準備預金残	4,549,600	4,542,600	4,495,700	4,467,800	4,474,300
マネタリーベース	6,233,700	6,201,800	6,162,100	6,138,600	6,144,900
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	100,197	104,903	105,357	109,430	111,480
うち無担	75,970	80,275	80,266	83,758	86,181
うちO/N	26,968	28,990	27,772	30,620	30,913
うち有担	24,227	24,628	25,091	25,672	25,299

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償額(億円)	非償額入札(億円)
30年利付国債	88	3.2%	7,000	2025/10/8	2055/9/20	18,310	5,368	99.10	3.259%	41.4864%	99.27	3.248%	1,628	

●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(%)	利回り(%)※1	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
米ドル資金供給		2025/10/9	2025/10/16	4.350		0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/10/7	2025/10/8	0.250	0.250	2,910	2,910		0.250	0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/10/7	2025/10/8	0.250	0.250	79	79		0.250	0.250	

※1. オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)、米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り、国債買現先の場合は、下限期間利回り、国債買入の場合は、下限利回較差。国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。

●2025年10月8日の予定

- *8月の毎月勤労統計調査速報
- *8月の国際収支
- *9月の景気ウォッチャー調査

◆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