

Central Daily Market Report

2025年12月5日(金)

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12月5日 需給速報	2025年12月8日 需給予想	2025年12月9日 当社予想
銀行券	▲ 500	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	0	2,000	▲ 1,000
資金過不足	▲ 500	1,000	▲ 2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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	▲ 500	
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 500	1,200	500
米ドル資金供給用担保譲り受け			
当預増減	100	1,000	▲ 2,000
当座預金残高	4,711,000	4,712,000	4,710,000
準備預金残高	4,325,900		
積み終了先	4,325,600	12月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,325,600	積数	1,400
非準備預金先	385,100	1日平均	200
積み期間 (11/16~12/15日) の所要準備額(積数)	3,987,700		
準備預金進捗率	実績 99.96%	日数 73.33%	

●2025年12月5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、週末3日積みとなったが相場に大きな変化はなく、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たことで、出合いの水準は0.477~0.478%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、0.50~0.51%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>

5日は、TDB3M物(第1348回)の入札が実施され、弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、特段の出合いは見られなかった。この他、1Y物でも出合いが見られた。

<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。

●短期金融市场関連指標

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	T+0	0.500	直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
O/N	0.450	0.650	0.477	1W		0.560			T+0	0.500	1.949	+0.014	50,491.87	▲ 536.55	155.12-14	154.62-63
T/N				2W					T+1	0.502						
S/N				3W					1W	0.497						
2日				1M					2W	0.497						
3日				2M					3W	0.531						
4日				3M	0.800	0.830	0.820		1M	0.590						
5日				4M					3M	0.625						
6日				5M					3M	0.663						
有担保コール(速報)				6M					6M	0.635						
O/N			0.430	1Y					1Y	0.780						
12/5																
日付	11/28	12/1	12/2	12/3	12/4											
日銀当預残	4,870,500	4,826,500	4,786,500	4,707,500	4,710,900											
準備預金残	4,495,500	4,448,700	4,404,400	4,325,800	4,330,500											
マネタリーベース	6,084,900	6,041,600	6,002,300	5,924,400	5,929,700											
無担保O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.477%	0.478%	0.477%											
コール市場残高	109,788	109,633	108,043	109,065	109,151											
うち無担	84,028	82,779	81,483	81,830	82,044											
うちO/N	35,930	34,371	34,401	35,938	34,702											
うち有担	25,760	26,854	26,560	27,235	27,107											

●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I非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1348	-	43,000	2025/12/8	2026/3/16	128,896	33,910	99,8295	0.6361%	19.4500%	99.8322	0.6260%	9,090	

●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)	按分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/12/5	2025/12/8		0.250	570	570		0.250	0.250
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/5	2025/12/8		0.250	0	0			

●2025年12月8日の予定

*10月の毎月勤労統計調査速報	*10月の国際收支
*7-9月期のGDP 2次速報	*11月の景気ウォッチャー調査

◆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。

◆本資料は何らかの取引を誘引すること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