

Central Daily Market Report

2025年12月8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12月8日 需給速報	2025年12月9日 需給予想	2025年12月10日 当社予想			
銀行券	▲ 1,000	▲ 1,500	▲ 1,000			
財政	1,900	▲ 500	▲ 24,000			
資金過不足	900	▲ 2,000	▲ 25,000			
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						
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		▲ 500		▲ 100		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 600	500		600		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	300	▲ 1,500		▲ 33,000		
当座預金残高	4,711,300	4,709,800		4,676,800		
準備預金残高	4,326,300					
積み終了先	4,325,900					
超過準備	4,325,900				12月9日以降の残り所要積立額 積数	1,000
非準備預金先	385,000				1日平均	100
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	99.97%		日数		76.67%

●2025年12月8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、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。
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>

8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

12/8	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	0.650	0.477	1W					T+0	0.500	1.965	+0.016	50,581.94	+90.07	155.30-32	155.35-36
T/N				2W	0.481	0.530	0.501		T+1	0.501						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.497						
3日				2M					2W	0.501						
4日				3M					3W	0.541						
5日				4M		0.760			1M	0.603						
6日			0.630	5M				3M	0.625	3M	0.676					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.635	6M	0.715					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.780	1Y	0.779					

日付	12/1	12/2	12/3	12/4	12/5
日銀当預残	4,826,500	4,786,500	4,707,500	4,710,900	4,711,000
準備預金残	4,448,700	4,404,400	4,325,800	4,330,500	4,325,000
マネタリーベース	6,041,600	6,002,300	5,924,400	5,929,700	5,930,400
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.478%	0.477%	0.477%
コール市場残高	109,633	108,043	109,065	109,151	101,646
うち無担	82,779	81,483	81,830	82,044	74,563
うちO/N	34,371	34,401	35,938	34,702	28,411
うち有担	26,854	26,560	27,235	27,107	27,083

●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	素分率	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(%)	利回り(%)※1	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/12/8	2025/12/9		0.250	639	639		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/8	2025/12/9		0.250	0	0				

●2025年12月9日の予定

*11月のマネーストック	*米FOMC(1日目)	*国庫短期証券(1349回)入札 (6ヶ月、35,000億円、12/10発行) *5年利付国債入札 (24,000億円、12/10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