

Central Daily Market Report

2025年12月12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12日 需給速報	2025年12月15日 需給予想	2025年12月16日 当社予想			
銀行券	▲ 1,500	▲ 1,900	▲ 1,000			
財政	▲ 10,700	66,200	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 12,200	64,300	▲ 2,000			
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						
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)			5,900	▲ 46,300		
被災地支援 社債等買入		▲ 200				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 900	300		900		
当預増減	▲ 13,000		24,800		▲ 2,000	
当座預金残高	4,669,800		4,694,600		4,692,600	
準備預金残高	4,280,200					
積み終了先	4,280,200					
超過準備	4,280,200					
非準備預金先	389,600					
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	100.00%	日数	96.67%		

●2025年12月12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、三日積みとなったものの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>

12日はTDB3M物(第1350回)の入札が実施され、強めの結果となった。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。

<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

12/12	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	0.478	0.477	1W	0.476	0.482	0.479		T+0	0.499	1.950	+0.025	50,836.55	+687.73	155.47-50	155.64-66
T/N				2W					T+1	0.503						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.498						
3日				2M					2W	0.551						
4日			0.630	3M					3W	0.580						
5日				4M					1M	0.631						
6日				5M					3M	0.692						
有担保コール(速報)				6M					6M	0.728						
O/N			0.430	1Y					1Y	0.792						

日付	12/5	12/8	12/9	12/10	12/11
日銀当預残	4,711,000	4,711,300	4,710,100	4,686,800	4,682,800
準備預金残	4,325,000	4,326,300	4,328,100	4,319,300	4,300,500
マネタリーベース	5,930,400	5,931,700	5,932,000	5,909,700	5,908,100
無担O/N加重平均	0.477%	0.477%	0.482%	0.477%	0.478%
コール市場残高	101,646	101,516	103,605	104,760	106,014
うち無担	74,563	74,473	76,719	76,963	78,785
うちO/N	28,411	28,221	30,907	30,291	31,213
うち有担	27,083	27,043	26,886	27,797	27,229

●入札結果

名称	回数	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非償付額(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1350	-	43,000	2025/12/15	2026/3/23	114,504	33,525.8	99.8305	0.6323%	90.5121%	99.8327	0.6241%	9,474	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/12/12	2025/12/15		0.250	1,009	1,009		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/12	2025/12/15		0.250	43	43		0.250	0.250	

●2025年12月15日の予定

*12月調査の日銀短観	*10月の第3次産業活動指数
-------------	----------------

◆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