

Central Daily Market Report

2025年12月15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15日 需給速報	2025年12月16日 需給予想	2025年12月17日 当社予想			
銀行券	▲ 1,900	▲ 2,100	▲ 1,500			
財政	59,900	1,200	▲ 5,000			
資金過不足	58,000	▲ 900	▲ 6,500			
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)	5,900	▲ 46,300				
被災地支援 社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 1,000	900	1,000			
*ドル資金供給用担保提供						
当増減	17,500	100	▲ 6,500			
当座預金残高	4,687,300	4,687,400	4,680,900			
準備預金残高	4,302,900					
積み終了先	4,302,900			12月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,302,900			積数	4,132,600	
非準備預金先	384,400			1日平均	133,300	
積み期間(12/16~1/15日)の所要準備額(積数)					4,132,600	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2025年12月15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%程度と横ばいで推移した。ターム物はショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.505%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>

15日のアウトライト市場は、3M物と6M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、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

12/15	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	0.530	0.477	1W	0.472	0.482	0.476		T+0	0.499	1.954	+0.004	50,168.11	▲ 668.44	155.86-88	155.25-27
T/N				2W					T+1	0.502						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.502						
3日				2M					2W	0.570						
4日				3M					3W	0.594						
5日				4M					1M	0.649						
6日			0.560	5M				3M	0.625	0.696						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.690	0.736						
O/N			0.430	1Y				1Y	0.810	0.804						

日付	12/8	12/9	12/10	12/11	12/12
日銀当預残	4,711,300	4,710,100	4,686,800	4,682,800	4,669,800
準備預金残	4,326,300	4,328,100	4,319,300	4,300,500	4,280,500
マネタリーベース	5,931,700	5,932,000	5,909,700	5,908,100	5,896,600
無担O/N加重平均	0.477%	0.482%	0.477%	0.478%	0.477%
コール市場残高	101,516	103,605	104,760	106,014	101,484
うち無担	74,473	76,719	76,963	78,785	74,396
うちO/N	28,221	30,907	30,291	31,213	27,274
うち有担	27,043	26,886	27,797	27,229	27,088

●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I非価格競争入札(億円)	第I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)		2025/12/15	2025/12/16		0.250	1,212	1,212		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/15	2025/12/16		0.250	0	0				

●2025年12月16日の予定

*11月の米雇用統計	*流動性供給入札(6,500億円、12/17発行)
*10月の米小売売上高	
*9月の米企業在庫	

◆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よう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