

Central Daily Market Report

2025年12月16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12月16日 需給速報	2025年12月17日 需給予想	2025年12月18日 当社予想	
銀行券	▲ 2,100	▲ 2,100	▲ 2,000	
財政	▲ 4,200	▲ 5,500	▲ 1,000	
資金過不足	▲ 6,300	▲ 7,600	▲ 3,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出	エンド	エンド	エンド	
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				
気候変動対応オペ				
国債補完供給	▲ 1,700	1,000	1,700	
当増減	▲ 7,000	▲ 5,900	▲ 3,000	
当座預金残高	4,680,300	4,674,400	4,671,400	
準備預金残高	4,303,100			
積み終了先	1,469,100			
超過準備	1,056,200			
非準備預金先	377,200			
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	78.57%	日数	3.23%

●2025年12月16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>

16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、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

12/16	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	日直値	前日比	終値	前日比	9時	17時		
O/N	0.450	0.530	0.482	1W	0.481	0.482	0.482	T+0	0.499	1.950	▲ 0.004	49,383.29	▲ 784.82	155.02-04	154.88-90	
T/N				2W				T+1	0.502							
S/N				3W				1W	0.526							
2日			0.471	1M				2W	0.598							
3日				2M				3W	0.619							
4日				3M				1M	0.663							
5日				4M				3M	0.701							
6日				5M				6M	0.742							
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.814							
O/N			0.430	1Y												

日付	12/9	12/10	12/11	12/12	12/15
日銀当預残	4,710,100	4,686,800	4,682,800	4,669,800	4,687,300
準備預金残	4,328,100	4,319,300	4,300,500	4,280,500	4,303,800
マネタリーベース	5,932,000	5,909,700	5,908,100	5,896,600	5,915,900
無担O/N加重平均	0.482%	0.477%	0.478%	0.477%	0.477%
コール市場残高	103,605	104,760	106,014	101,484	104,718
うち無担	76,719	76,963	78,785	74,396	76,400
うちO/N	30,907	30,291	31,213	27,274	28,948
うち有担	26,886	27,797	27,229	27,088	28,318

●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非償額(億円)	非償額入札(億円)
流動性供給	443	-	6,500	2025/12/17	-	20,129	6,487		▲0.001%	27.0547%		▲0.004%		

●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		2025/12/18	2025/12/26	3.900		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/12/16	2025/12/17		0.250	1,930	1,930		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/16	2025/12/17		0.250	96	96		0.250	0.250	

●2025年12月17日の予定

*7-9月期資金循環統計速報	*11月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(第1351回)入札(1年、32,000億円、12/22発行)
*11月の貿易統計	*11月の英消費者物価指数	
*10月の機械受注統計		
*10月の石油等消費動態統計		

●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