

Central Daily Market Report

2025年12月22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22日 需給速報	2025年12月23日 需給予想	2025年12月24日 当社予想			
銀行券	▲ 2,300	▲ 2,800	▲ 2,000			
財政	50,700	▲ 5,200	▲ 2,500			
資金過不足	48,400	▲ 8,000	▲ 4,500			
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						▲ 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				▲ 100		
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	▲ 6,600	1,700		6,600		
当増増減	43,500	▲ 1,500		▲ 12,500		
当座預金残高	4,729,700	4,728,200		4,715,700		
準備預金残高	4,327,500					
積み終了先	4,320,700					
超過準備	4,319,200				12月23日以降の残り所要積立額 積数	15,400
非準備預金先	402,200				1日平均	600
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	99.63%		日数		22.58%

●2025年12月22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たことや、先日の決定会合の結果を受けたことで、出合いの水準は0.725~0.728%程度と前営業日対比で大幅に上昇した。ターム物では、1W~1M程度での引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.735~0.745%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>

22日のアウトライイト市場は、1Y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。追加利上げの影響から0.75%以上で推移し、銘柄によって投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

12/22	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	0.700	0.780	0.727	1W	0.720	0.870	0.761		T+0	0.743	2.080	+0.060	50,402.39	+895.18	157.62-67	157.47-50
T/N				2W	0.726	0.740	0.728		T+1	0.740						
S/N	0.710	0.720	0.715	3W					1W	0.724						
2日				1M			0.830		2W	0.711						
3日			0.850	2M					3W	0.719						
4日				3M	0.830	0.850	0.840		1M	0.721						
5日				4M					3M	0.734						
6日	0.727	0.730	0.728	5M				3M	0.640	3M	0.734					
有担保コール(速報)				6M				6M	0.690	6M	0.757					
O/N			0.680	1Y				1Y	0.885	1Y	0.846					

日付	12/15	12/16	12/17	12/18	12/19
日銀当預残	4,687,300	4,680,300	4,666,000	4,683,200	4,686,200
準備預金残	4,303,800	4,303,100	4,293,300	4,292,700	4,286,700
マネタリーベース	5,915,900	5,911,100	5,898,900	5,919,100	5,924,700
無担O/N加重平均	0.477%	0.482%	0.478%	0.477%	0.477%
コール市場残高	104,718	107,305	105,437	104,055	99,731
うち無担	76,400	78,455	76,651	75,407	71,021
うちO/N	28,948	31,323	29,649	29,425	27,673
うち有担	28,318	28,850	28,786	28,648	28,710

●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	案分率	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(利回り)
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)		2025/12/22	2025/12/23		0.450	7,103	7,103		0.450	0.449	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/22	2025/12/23		0.450	0	0				

●2025年12月23日の予定

*7-9月期の米GDP速報値 *10月の米耐久財受注	*10・11月の米鉱工業生産	*流動性供給入札 (2,500億円、12/24発行)
-------------------------------	----------------	-------------------------------

◆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