

Central Daily Market Report

2025年12月23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23日 需給速報	2025年12月24日 需給予想	2025年12月25日 当社予想			
銀行券	▲ 2,800	▲ 2,700	▲ 2,800			
財政	▲ 9,900	▲ 4,100	2,000			
資金過不足	▲ 12,700	▲ 6,800	▲ 800			
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	▲ 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		▲ 400		
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		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 4,600	6,600		4,600		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増増減	▲ 10,800	▲ 3,100		▲ 800		
当座預金残高	4,718,900	4,715,800		4,715,000		
準備預金残高	4,322,000					
積み終了先	4,320,300					
超過準備	4,318,500				12月24日以降の残り所要積立額 積数	11,900
非準備預金先	396,900				1日平均	500
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	99.71%	日数	25.81%		

●2025年12月23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で、出合いの水準は0.725~0.728%程度で推移した。ターム物では、1W~1M程度での引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.74~0.75%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>

23日のアウトライト市場は、3M物、6M物、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。発行レートは、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

12/23	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	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	0.690	0.780	0.727	1W					T+0	0.735	2.040	▲ 0.040	50,412.87	+10.48	156.90-92	156.07-08
T/N				2W	0.728	0.731	0.729		T+1	0.738						
S/N				3W			0.900									
2日				1M	0.825	0.970	0.881		1W	0.719						
3日				2M			0.830		2W	0.709						
4日				3M			0.835		3W	0.717						
5日				4M					1M	0.722						
6日				5M					3M	0.733						
有担保コール(速報)				6M					6M	0.759						
O/N			0.680	1Y					1Y	0.853						

日付	12/16	12/17	12/18	12/19	12/22
日銀当預残	4,680,300	4,666,000	4,683,200	4,686,200	4,729,700
準備預金残	4,303,100	4,293,300	4,292,700	4,286,700	4,325,100
マネタリーベース	5,911,100	5,898,900	5,919,100	5,924,700	5,970,400
無担O/N加重平均	0.482%	0.478%	0.477%	0.477%	0.727%
コール市場残高	107,305	105,437	104,055	99,731	101,661
うち無担	78,455	76,651	75,407	71,021	71,164
うちO/N	31,323	29,649	29,425	27,673	29,897
うち有担	28,850	28,786	28,648	28,710	30,497

●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非価格額(億円)	非競争入札(億円)
流動性供給	444	-	2,500	2025/12/24	-	8,283	2,498		▲0.037%	53.3333%		▲0.050%		

●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		2025/12/26	2026/1/8	3.900		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/12/23	2025/12/24		0.450	4,662	4,662		0.450	0.450	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2025/12/24	2026/1/7	0.750		14,966	8,003				53.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/23	2025/12/24		0.450	251	251		0.450	0.450	

●2025年12月24日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(10月29,30日分)	*12月の米CB消費者信頼感指数
*11月の企業向けサービス価格指数	
*10月の景気動向指数改訂状況	

◆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