

Central Daily Market Report

2025年12月25日(木)

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25日 需給速報	2025年12月26日 需給予想	2025年12月29日 当社予想
銀行券	▲ 3,200	▲ 2,400	▲ 3,000
財政	21,100	500	▲ 5,000
資金過不足	17,900	▲ 1,900	▲ 8,000
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	7,200		
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	▲ 100		
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 3,300	3,700	3,300
米ドル資金供給用担保譲渡供給			
当預増減	25,400	1,400	▲ 8,000
当座預金残高	4,736,500	4,737,900	4,729,900
準備預金残高	4,332,000		
積み終了先	4,330,700		
超過準備	4,330,600		
非準備預金先	404,500		
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額(積数)	4,132,600		
準備預金進捗率	実績 99.78%	日数 32.26%	

●2025年12月25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、1M程度の期間での引き合いが見受けられた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.74~0.75%程度での出合いとなった。SC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>

25日のアウトライト市場は、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。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

12/25	無担保コール(速報)						壳買参考統計値	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	平均値	直近値	前日比	終値	前日比
O/N	0.700	0.780	0.728	1W				T+0 0.744	2.045	0.000	50,407.79	+63.69
T/N				2W	0.720	0.731	0.724	T+1 0.743			155.90-99	155.90-10
S/N				3W								
2日				1M								
3日				2M								
4日			0.850	3M								
5日				4M								
6日				5M								
有担保コール(速報)		6M			6M	0.690	6M	0.761				
O/N		0.680	1Y				1Y 0.885	1Y 0.863				

●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・利回較差	来分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
2年利付国債	480	1.1%	28,000	2026/1/5	2028/1/1	72,138	22,158	99,920	1.141%	64.3266%	99.942	1.129%	5,838	0.29

●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)		2025/12/25	2025/12/26		0.450	3,380	3,380		0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/25	2025/12/26		0.450	141	141		0.450	0.450	

●2025年12月26日の予定

*12月の都区部消費者物価指数	*11月の商業動態統計速報	*Euro祝日(Christmas Holiday)
*11月の労働力調査	*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*London祝日(Boxing Day)
*11月の一般職業紹介状況		

◆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本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