

Central Daily Market Report

2025年12月26日(金)

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26日 需給速報	2025年12月29日 需給予想	2025年12月30日 当社予想			
銀行券	▲ 2,400	▲ 1,100	▲ 500			
財政	▲ 2,800	1,400	▲ 5,500			
資金過不足	▲ 5,200	300	▲ 6,000			
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)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 2,300	3,300	2,300			
当増増減	▲ 4,200	2,600	▲ 6,000			
当座預金残高	4,732,300	4,734,900	4,728,900			
準備預金残高	4,318,200					
積み終了先	4,317,600			12月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,317,300			積数	6,300	
非準備預金先	414,100			1日平均	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	99.85%	日数	41.94%		

●2025年12月26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、週末を迎え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程度の期間での引き合いが見受けられた。

<レボ市場>

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>

26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、月末発行にあたり、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

12/26	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	0.728	0.727	1W	0.710	0.731	0.720	T+0	0.741	2.040	▲ 0.005	50,750.39	+342.60	156.12-14	156.36-38	
T/N				2W			0.728	T+1	0.741							
S/N				3W				1W	0.718							
2日				1M				2W	0.718							
3日				2M				3W	0.724							
4日				3M			0.830	1M	0.729							
5日				4M				3M	0.736							
6日				5M				6M	0.762							
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.885							
O/N			0.680	1Y				1Y	0.866							

日付	12/19	12/22	12/23	12/24	12/25
日銀当預残	4,686,200	4,729,700	4,718,900	4,711,100	4,736,500
準備預金残	4,286,700	4,325,100	4,322,500	4,305,800	4,332,000
マネタリーベース	5,924,700	5,970,400	5,962,500	5,957,400	5,986,000
無担O/N加重平均	0.477%	0.727%	0.727%	0.727%	0.728%
コール市場残高	99,731	101,661	101,720	100,830	102,244
うち無担	71,021	71,164	73,869	73,416	75,432
うちO/N	27,673	29,897	29,562	27,014	28,280
うち有担	28,710	30,497	27,851	27,414	26,812

●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)		2025/12/26	2025/12/29		0.450	2,455	2,455		0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/26	2025/12/29		0.450	0	0				

●2025年12月29日の予定

* 決定会合における主な意見(12月18,19日分)

◆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