

Central Daily Market Report

2025年12月29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29日 需給速報	2025年12月30日 需給予想	2026年1月5日 当社予想			
銀行券	▲ 1,100	400	7,000			
財政	▲ 9,200	▲ 2,800	▲ 7,400			
資金過不足	▲ 10,300	▲ 2,400	▲ 400			
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	▲ 2,800	2,300	2,800			
当増増減	▲ 10,800	400	▲ 400			
当座預金残高	4,721,500	4,721,900	4,721,500			
準備預金残高	4,307,300					
積み終了先	4,306,400			12月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,306,400			積数	5,400	
非準備預金先	414,200			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	99.87%	日数	45.16%		

●2025年12月29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0.727~0.728%程度で推移した。ターム物は1W~1M程度の期間で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.655~0.76%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>

29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、0.75%以上で推移し、銘柄や期間により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

12/29	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	0.728	1W	0.720	0.731	0.729	T+0	0.739	2.055	+0.015	50,526.92	▲ 223.47	156.47-49	156.07-09	
T/N			0.880	2W	0.710	0.900	0.756	T+1	0.737							
S/N				3W												
2日				1M			0.850	1W	0.729							
3日				2M				2W	0.728							
4日				3M				3W	0.729							
5日				4M				1M	0.733							
6日				5M				3M	0.739							
有担保コール(速報)				6M				6M	0.762							
O/N			0.680	1Y				1Y	0.872							

日付	12/22	12/23	12/24	12/25	12/26
日銀当預残	4,729,700	4,718,900	4,711,100	4,736,500	4,732,300
準備預金残	4,325,100	4,322,500	4,305,800	4,332,000	4,319,400
マネタリーベース	5,970,400	5,962,500	5,957,400	5,986,000	5,984,200
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.728%	0.727%
コール市場残高	101,661	101,720	100,830	102,244	96,687
うち無担	71,164	73,869	73,416	75,432	72,158
うちO/N	29,897	29,562	27,014	28,280	26,605
うち有担	30,497	27,851	27,414	26,812	24,529

●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)		2025/12/29	2025/12/30		0.450	3,065	3,065		0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/29	2025/12/30		0.450	0	0				

●2025年12月30日の予定

*12月のシカゴPM景況感指数
*10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

◆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