

# Central Daily Market Report

2025年12月30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30日 需給速報	2026年1月5日 需給予想	2026年1月6日 当社予想
銀行券	700	2,100	6,000
財政	▲ 13,600	▲ 10,100	▲ 9,000
資金過不足	▲ 12,900	▲ 8,000	▲ 3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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	▲ 1,700	2,800	1,700
米ドル資金供給所担保国債供給			
当預増減	▲ 11,800	▲ 6,300	▲ 3,000
当座預金残高	4,709,700	4,703,400	4,700,400
準備預金残高	4,289,700		
積み終了先	4,288,800	1月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,288,800	積数	400
非準備預金先	420,000	1日平均	0
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 99.99%	日数 64.52%	

## ●2025年12月30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、四半期末要因により一部で調達を見合せる動きが見られたものの、資金調達ニーズの強い状況に変わりはなく、引き続き0.727～0.728%程度での出会いが中心となった。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、0.745～0.755%程度での出会いとなった。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>

30日のアウトライト市場は、1Y物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、多くの企業が年末年始の休業期間に入っており、入札を行う先は見られなかった。

## ●短期金融市场関連指標

12/30	無担保コール(速報)						売買参考統計値	東京レポート	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均		
O/N	0.700	0.728	0.727	1W					T+0 0.747
T/N				2W	0.728	0.731	0.730		T+1 0.752
S/N				3W					1W 0.737
2日				1M			0.800		2W 0.733
3日				2M	0.790	0.800	0.793		3W 0.733
4日		0.850		3M			0.850		1M 0.735
5日				4M					3M 0.650
6日				5M					3M 0.742
有担保コール(速報)				6M					6M 0.725
O/N		0.680	1Y						1Y 0.920

JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)	
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
2.070	+0.015	50,339.48	▲ 187.44	155.97-99	155.97-99
日付	12/23	12/24	12/25	12/26	12/29
日銀当預残	4,718,900	4,711,100	4,736,500	4,732,300	4,721,500
準備預金残	4,322,500	4,305,800	4,332,000	4,319,400	4,307,300
マネタリーベース	5,962,500	5,957,400	5,986,000	5,984,200	5,974,600
無担保O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.728%	0.727%	0.728%
コール市場残高	101,720	100,830	102,244	96,687	98,989
うち無担保	73,869	73,416	75,432	72,158	74,898
うちO/N	29,562	27,014	28,280	26,605	27,865
うち有担保	27,851	27,414	26,812	24,529	24,091

## ●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	来分率	募入平均価格	募入平均利回	第I非価格競争入札(億円)	第II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	賞付利率(%)※1	利回り(%)※1	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	検分レート・利回り較差・価格較差	全取引レート・利回り較差・価格較差	平均落札レート・利回り較差・価格較差	検分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/12/30	2026/1/5	0.450	1,828	1,828	0.450				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/30	2026/1/5	0.450	0	0	0				

## ●2025年12月31日の予定

\*銀行休業日(国内)・大晦日

## ●2026年1月1日の予定

\*元旦  
\*NY、Euro、London祝日  
(New Year's Day)

## ●2026年1月2日の予定

\*銀行休業日(国内)

## ●2026年1月5日の予定

\*12月のISM製造業景況指数

本年も大変お世話になりました。ありがとうございました。来年もよろしくお願い申し上げます。

◆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導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自論見書をよくお読みください。  
 セントラル短資株式会社 登録金融機関東財務局長(登金) 第526号 日本証券業協会加入