

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	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	▲ 1,700	2,800		1,700		
※ドル資金供給開始前日国債買供給						
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日）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わ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%程度での出合いが中心となった。
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＞

30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、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。

●短期金融市場関連指標

12/30	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						T+0	0.747	2.070	+0.015	50,339.48	▲ 187.44	155.97~99	155.97~99
T/N				2W	0.728	0.731	0.730			T+1	0.752						
S/N				3W													
2日				1M			0.800			1W	0.737						
3日				2M	0.790	0.800	0.793			2W	0.733						
4日			0.850	3M			0.850			3W	0.733						
5日				4M						1M	0.735						
6日				5M				3M	0.650	3M	0.742						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.725	6M	0.766						
O/N			0.680	1Y				1Y	0.920	1Y	0.878						
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		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		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	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(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)		2025/12/30	2026/1/5		0.450	1,828	1,828		0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/30	2026/1/5		0.450	0	0				

●2025年12月31日の予定

●2026年1月1日の予定

●2026年1月2日の予定

●2026年1月5日の予定

*銀行休業日(国内)・大晦日	*元旦 *NY、Euro、London祝日 (New Year's Day)	*銀行休業日(国内)	*12月のISM製造業景況指数
----------------	--	------------	-----------------

本年も大変お世話になり、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さ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 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入