

Central Daily Market Report

2025年12月2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2日 需給速報	2025年12月3日 需給予想	2025年12月4日 当社予想			
銀行券	▲ 800	▲ 1,100	▲ 1,000			
財政	▲ 39,800	▲ 77,600	2,000			
資金過不足	▲ 40,600	▲ 78,700	1,000			
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		▲ 100		▲ 700		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 2,200	2,900		2,200		
※下引資金供給用担保提供枠						
当増増減	▲ 40,000	▲ 77,200		1,000		
当座預金残高	4,786,500	4,709,300		4,710,300		
準備預金残高	4,403,900					
積み終了先	4,403,100					
超過準備	4,403,100				12月3日以降の残り所要積立額 積数	3,600
非準備預金先	382,600				1日平均	300
積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(積数)						3,979,900
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	56.67%		

●2025年12月2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資金調達ニーズが見られ、出合いの水準は変わらず0.477~0.478%程度で推移した。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.50~0.505%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>

2日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、複数業態で発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

12/2	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	0.450	0.530	0.477	1W	0.478	0.550	0.491		T+0	0.500	1.855	▲ 0.020	49,303.45	+0.17	155.56-57	155.76-78
T/N				2W	0.475	0.481	0.478		T+1	0.501						
S/N				3W	0.540	0.660	0.557									
2日				1M					1W	0.496						
3日				2M					2W	0.496						
4日				3M					3W	0.505						
5日				4M					1M	0.543						
6日			0.630	5M				3M	0.580	0.639						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.620	0.673						
O/N			0.430	1Y				1Y	0.755	0.754						

日付	11/25	11/26	11/27	11/28	12/1
日銀当座預金	4,895,000	4,883,500	4,877,400	4,870,500	4,826,500
準備預金残	4,506,800	4,504,900	4,503,900	4,485,500	4,448,700
マネタリーベース	6,108,300	6,096,500	6,091,400	6,084,900	6,041,600
無担O/N加重平均	0.478%	0.478%	0.477%	0.477%	0.477%
コール市場残高	116,531	114,464	113,543	109,788	109,633
うち無担	89,305	88,142	85,412	84,028	82,779
うちO/N	37,097	35,324	34,834	35,930	34,371
うち有担	27,226	26,322	28,131	25,760	26,854

●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	案分率	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)
10年利付国債	380	1.7%	26,000	2025/12/3	2035/9/20	70,397	19,602	98.53	1.877%	21.1502%	98.57	1.872%	6,388	4.52

●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
米ドル資金供給		2025/12/4	2025/12/11	4.140		2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/12/2	2025/12/3		0.250	2,297	2,297		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/12/2	2025/12/3		0.250	2	2		0.250	0.250	

●2025年12月3日の予定

*12月の日銀当座預金増減要因見込み	*11月のISM非製造業景況指数
	*9月の米鉱工業生産

◆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いますが、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り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