

Central Daily Market Report

2025年11月27日(木)

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11月27日 需給速報	2025年11月28日 需給予想	2025年12月1日 当社予想
銀行券	▲ 1,000	▲ 400	▲ 300
財政	▲ 6,800	▲ 5,100	▲ 22,700
資金過不足	▲ 7,800	▲ 5,500	▲ 23,000
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		7,300	
CP等買入			
貸出支援基金(成)			▲ 2,500
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	▲ 100	▲ 100	
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 1,500	3,300	1,500
米ドル資金供給用担保譲り受け			
当預増減	▲ 6,100	3,200	▲ 25,500
当座預金残高	4,877,400	4,880,600	4,855,100
準備預金残高	4,503,500		
積み終了先	4,502,000	11月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,502,000	積数	9,400
非準備預金先	373,900	1日平均	500
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 99.76%	日数 40.00%	

●2025年11月27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、0.495~0.50%程度での出合いとなった。SC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>

27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、複数の発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

無担保コール(速報)							短国		東京レポレート	
単位 : %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	T+0	0.500
O/N	0.450	0.530	0.477	1W	0.550	0.560	0.551		T+1	0.495
T/N				2W	0.471	0.481	0.474			
S/N				3W			0.600			
2日				1M			0.670			
3日				2M						
4日				3M						
5日				4M						
6日				5M						
有担保コール(速報)			6M				3M 0.490	3M 0.594	3M 0.646	
O/N		0.430	1Y				1Y 0.745	1Y 0.747		

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
1.795	▲ 0.020	50,167.10	+608.03	156.21-23	156.10-12
日付	11/19	11/20	11/21	11/25	11/26
日銀当預残	4,890,100	4,887,800	4,899,000	4,895,000	4,883,500
準備預金残	4,483,500	4,481,500	4,504,700	4,506,800	4,504,900
マネタリーベース	6,102,200	6,100,000	6,111,700	6,108,300	6,096,500
無担O/N加重平均	0.479%	0.477%	0.478%	0.478%	0.478%
コール市場残高	111,064	108,477	114,741	116,531	114,464
うち無担	82,876	80,954	87,498	89,305	88,142
うちO/N	30,273	29,161	35,585	37,097	35,324
うち有担	28,188	27,523	27,243	27,226	26,322

●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 ・利回り較差 ・価格較差	全取レート ・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	按分 比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,800	2025/11/28				6,503	2,804	▲0.015	▲0.012	58.8	
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,050	2025/11/28				7,726	3,058	▲0.023	▲0.020	69.9	
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,150	2025/11/28				3,429	1,154	▲0.024	▲0.021	49.5	
国債買入(物価連動債)	500	2025/11/28				1,676	500		▲0.150	▲0.184	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/11/27	2025/11/28	0.250	1,326	1,326			0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/11/27	2025/11/28	0.250	130	130			0.250	0.250	

●2025年11月28日の予定

*11月の都区部消費者物価指数

*10月の労働力調査

*10月の一般職業紹介状況

*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報

*10月の商業動態統計速報

*10月の住宅着工統計

*国庫短期証券(1347回)入札

(3か月、43,000億円、12/1発行)

*2年利付国債入札

(27,000億円、12/1借入)

◆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