Central Daily Market Report

2026年11月26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	2026年11月26日 需給速報		2026年11月27日 需給予想		2026年11月30日 当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 200		▲ 1,500	
財政	▲ 3,700		▲ 11,000		10,800	
資金過不足	▲ 4,600		▲ 11,200		9,300	
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			3,900			
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 300		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 500	100		500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 5,100		▲ 7,100		9,300	
当座預金残高	4,089,800		4,082,700		4,092,000	
準備預金残高	3,740,100					
積み終了先	3,739,700					
超過準備	3,738,200					
非準備預金先	349,700					

11月27日以降の残り所要積立額	
積数	2,400
1日平均	100

積み期間（11/16～12/15日）の所要準備額（積数）			4,032,800
準備預金進捗率	実績 99.94%	日数	36.67%

●2026年11月26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たことで、出合いの水準は1.225～1.228%程度で推移した。
ターム物では、引き続き短い期間での引き合いが見受けられた。

<レポ市場>
GC T/Nは、1.255%程度の出合いとなった。
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>
26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市場は、月末発行にあたり、複数の業態で大型発行が実施された。
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

11/26	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	
O/N	1.190	1.275	1.227	1W	1.225	1.310	1.248		T+0	1.249
T/N				2W	1.232	1.235	1.234		T+1	1.250
S/N				3W			1.340			
2日				1M					1W	1.250
3日				2M					2W	1.250
4日				3M			1.645		3W	1.250
5日				4M			1.730		1M	1.279
6日				5M				3M 1.250	3M	1.408
有担保コール（速報）				6M				6M 1.400	6M	1.470
翌日物			1.180	1Y				1Y 1.590	1Y	1.654

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
2.635	▲ 0.010	57,499.16	+487.54	159.20-22	159.16-18

日付	11/18	11/19	11/20	11/24	11/25
日銀当預残	4,112,400	4,096,000	4,101,600	4,098,100	4,094,900
準備預金残	3,759,800	3,747,800	3,752,600	3,749,600	3,754,200
マネタリーベース	5,298,800	5,283,000	5,289,400	5,286,400	5,283,400
無担O/N加重平均	1.227%	1.228%	1.228%	1.227%	1.227%
コール市場残高	126,173	126,668	130,055	127,972	126,360
うち無担	102,854	103,571	104,378	100,289	98,978
うちO/N	35,995	35,992	38,629	34,660	33,319
うち有担	23,319	23,097	25,677	27,683	27,382

●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。

●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
国債買入（残存期間3年超5年以下）	2,900	2026/11/27				7,292	2,902	0.037		0.042	55.1
国債買入（残存期間10年超25年以下）	850	2026/11/27				3,769	851	0.009		0.011	80.0
国債買入（物価連動債）	300	2026/11/27				1,378	300	0.250		0.037	8.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/11/26	2026/11/27		0.800	540	540		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/26	2026/11/27		0.800	0	0				

●2026年11月27日の予定

*10月の有効求人倍率(厚労省 8:30)
*10月の完全失業率(総務省 8:30)
*11月の都区部消費者物価指数(総務省 8:30)
*New York市場短縮取引
*国庫短期証券(1422回)入札
（3ヶ月、31,000億円、11/30発行）
*流動性供給
（5,000億円、11/30発行）

◆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