Central Daily Market Report

2026年11月27日（金）
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27日 需給速報		2026年11月30日 需給予想		2026年12月1日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 200		▲ 600	
財政	▲ 11,700		6,700		▲ 35,000	
資金過不足	▲ 11,800		6,500		▲ 35,600	
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		▲ 300				
気候変動対応オペ						
国債補完供給		500				
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 7,700		6,500		▲ 35,600	
当座預金残高	4,082,100		4,088,600		4,053,000	
準備預金残高	3,742,000					
積み終了先	3,741,900		11月30日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,741,800		積数	1,700		
非準備預金先	340,100		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	99.96%	日数	46.67%		

●2026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>
27日はTDB3M物（第1422回）の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは堅調に推移した。

<CP市場>
CP発行市場は、一部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

11/27	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	1.200	1.229	1.227	1W	1.225	1.280	1.246			T+0	1.250
T/N			1.220	2W						T+1	1.250
S/N				3W							
2日				1M						1W	1.250
3日			1.289	2M			1.570			2W	1.250
4日			1.350	3M	1.620	1.700	1.660			3W	1.250
5日				4M						1M	1.289
6日				5M				3M	1.260	3M	1.410
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
2.640	+0.005	58,711.11	+1,211.95	159.28-30	159.33-35

日付	11/19	11/20	11/24	11/25	11/26
日銀当預残	4,096,000	4,101,600	4,098,100	4,094,900	4,089,800
準備預金残	3,747,800	3,752,600	3,749,600	3,754,200	3,740,200
マネタリーベース	5,283,000	5,289,400	5,286,400	5,283,400	5,279,200
無担O/N加重平均	1.228%	1.228%	1.227%	1.227%	1.227%
コール市場残高	126,668	130,055	127,972	126,360	124,273
うち無担	103,571	104,378	100,289	98,978	97,446
うちO/N	35,992	38,629	34,660	33,319	33,277
うち有担	23,097	25,677	27,683	27,382	26,827

●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）	募入決定額（億円）	募入最低価格	募入最高利回り・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回り・利回較差	第Ⅰ非価格競争入札（億円）	非競争入札（億円）
国庫短期証券	1422	－	31,000	2026/11/30	2027/3/8	88,946	23,927.8	99.6600	1.2706%	71.2328%	99.6633	1.2582%	7,072	
流動性供給	466	－	5,000	2026/11/30	－	19,437	4,991		▲0.013%	93.6049%		▲0.014%		

●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）		2026/11/27	2026/11/30		0.800	15	15		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/27	2026/11/30		0.800	0	0				

※1. オペの種類が、国債補完供給（国債売現先）、米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）の場合は、上限期間利回り。国債買現先の場合は、下限期間利回り。国債買入の場合は、下限利回較差。国債買入（固定利回り方式）の場合は、固定利回較差。

●2026年11月30日の予定

*10月の鉱工業生産速報(経産省 8:50)
*10月の商業動態統計速報(経産省 8:50)
*10月の決済動向(日銀 11:00)
*植田総裁挨拶(名古屋懇談会 10:05)
*11月のシカゴPM景況感指数
*2年利付国債入札
（28,000億円、12/1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