Central Daily Market Report

2026年11月2日（月）

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2日 需給速報	2026年11月4日 需給予想	2026年11月5日 当社予想
銀行券	▲ 700	▲ 100	800
財政	▲ 16,400	▲ 21,800	▲ 5,000
資金過不足	▲ 17,100	▲ 21,900	▲ 4,200

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						
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						
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減		▲ 17,200		▲ 22,000		▲ 4,200

当座預金残高	4,167,900	4,145,900	4,141,700
準備預金残高	3,842,500		
積み終了先	3,842,400	11月4日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,842,400	積数	200
非準備預金先	325,400	1日平均	0
積み期間（10/16～11/15日）の所要準備額（積数）			4,163,000
準備預金進捗率	実績 100.00%	日数	61.29%

●2026年11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、相場に大きな変化はなく、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、1.227～1.228%程度で推移した。
ターム物では、ショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<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>

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

11/2	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	1.203	1.229	1.227	1W	1.223	1.350	1.256		T+0	1.250
T/N				2W	1.228	1.370	1.247		T+1	1.250
S/N				3W			1.345			
2日				1M	1.285	1.430	1.346		1W	1.250
3日				2M					2W	1.250
4日			1.220	3M			1.570		3W	1.250
5日			1.223	4M					1M	1.253
6日				5M				3M 1.200	3M	1.348
有担保コール（速報）				6M				6M 1.355	6M	1.447
翌日物			1.180	1Y				1Y 1.615	1Y	1.652

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
2.770	0.000	63,081.86	▲ 208.25	157.67-69	157.74-76

日付	10/26	10/27	10/28	10/29	10/30
日銀当預残	4,183,000	4,182,700	4,180,500	4,189,700	4,185,100
準備預金残	3,856,300	3,861,700	3,863,200	3,868,000	3,848,300
マネタリーベース	5,370,000	5,369,800	5,367,700	5,377,500	5,372,700
無担O/N加重平均	1.227%	1.227%	1.227%	1.227%	1.227%
コール市場残高	124,274	124,736	123,193	123,946	119,622
うち無担	101,588	101,633	101,398	102,180	97,853
うちO/N	33,739	33,489	33,424	33,386	31,944
うち有担	22,686	23,103	21,795	21,766	21,769

●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）
GX5年利付国債	6	2.20%	2,500	2026/11/4	2031/9/20	9,599	2,498	100.00	2.200%	35.2066%				

●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）		2026/11/2	2026/11/4		0.800	36	36		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/2	2026/11/4		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4日の予定

*10月のマネタリーベース(日銀 8:50)
*財政等対民間収支(財務省 15:00)
*10月の消費者物価指数(HICP速報値)
*10月の米ADP雇用統計
*10月のISM非製造業景況指数

◆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