Central Daily Market Report

2026年11月6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6日 需給速報		2026年11月9日 需給予想		2026年11月10日 当社予想	
銀行券	800		300		200	
財政	▲ 30,400		7,500		7,000	
資金過不足	▲ 29,600		7,800		7,200	
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		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 1,000	200		1,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 30,400		8,700		7,200	
当座預金残高	4,128,200		4,136,900		4,144,100	
準備預金残高	3,799,000					
積み終了先	3,799,000		11月9日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,799,000		積数	0		
非準備預金先	329,200		1日平均	0		
積み期間（10/16～11/15日）の所要準備額（積数）				4,157,300		
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	77.42%		

●2026年11月6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>
6日はTDB3M物（第1417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、強含みで推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

<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

11/6	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	1.250	1.229	1W	1.225	1.330	1.253		T+0	1.250
T/N			1.220	2W			1.330		T+1	1.250
S/N				3W						
2日				1M	1.305	1.540	1.347		1W	1.250
3日				2M					2W	1.250
4日				3M			1.570		3W	1.250
5日				4M					1M	1.253
6日				5M				3M	1.180	3M	1.352
有担保コール（速報）				6M				6M	1.330	6M	1.444
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.525	1Y	1.642

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	▲ 0.120	57,434.77	▲ 3,643.13	157.47-51	157.94-96

日付	10/29	10/30	11/2	11/4	11/5
日銀当預残	4,189,700	4,185,100	4,167,900	4,144,800	4,158,600
準備預金残	3,868,000	3,848,300	3,844,000	3,811,200	3,824,000
マネタリーベース	5,377,500	5,372,700	5,356,200	5,333,100	5,346,600
無担O/N加重平均	1.227%	1.227%	1.227%	1.228%	1.227%
コール市場残高	123,946	119,622	120,228	122,315	121,506
うち無担	102,180	97,853	97,822	99,811	99,253
うちO/N	33,386	31,944	33,068	33,637	32,519
うち有担	21,766	21,769	22,406	22,504	22,253

●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	1417	－	31,000	2026/11/9	2027/2/15	103,471	23,832.9	99.6660	1.2481%	88.7115%	99.6679	1.2410%	7,167	

●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）		2026/11/6	2026/11/9		0.800	1,141	1,141		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/6	2026/11/9		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9日の予定

*10月のオペレーション(日銀 8:50)
*10月の日本銀行の対政府取引(日銀 8:50)
*10月のマネタリーベースと取引(日銀 8:50)
*9月の消費活動指数(日銀 14:00頃)
*10月のコール市場残高(日銀 15:00)
*9月の景気動向指数速報(内閣府 14:00)

*国庫短期証券(1418回)入札
（6ヶ月、30,000億円、11/10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