Central Daily Market Report

2026年11月12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12日 需給速報	2026年11月13日 需給予想	2026年11月16日 当社予想
銀行券	0	200	▲ 100
財政	13,200	▲ 18,700	▲ 8,500
資金過不足	13,200	▲ 18,500	▲ 8,600

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		▲ 100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,500					
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 800	100		800		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	18,900		▲ 17,700		▲ 8,600	

当座預金残高	4,145,900	4,128,200	4,119,600
準備預金残高	3,811,400		
積み終了先	3,811,400	11月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,811,400	積数	0
非準備預金先	334,500	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 90.32%

●2026年11月12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>
11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

11/12	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	1.228	1.227	1W	1.222	1.320	1.262		T+0	1.250
T/N				2W	1.232	1.360	1.279		T+1	1.250
S/N				3W						
2日				1M			1.350		1W	1.250
3日				2M					2W	1.250
4日				3M			1.600		3W	1.250
5日				4M					1M	1.251
6日				5M				3M	1.290	3M	1.371
有担保コール（速報）				6M				6M	1.420	6M	1.449
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.600	1Y	1.646

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
2.790	0.000	60,819.36	▲ 429.23	159.75-77	159.70-71

日付	11/5	11/6	11/9	11/10	11/11
日銀当預残	4,158,600	4,128,200	4,134,700	4,136,200	4,127,000
準備預金残	3,824,000	3,799,000	3,798,900	3,790,900	3,791,900
マネタリーベース	5,346,600	5,315,400	5,321,600	5,322,700	5,313,300
無担O/N加重平均	1.227%	1.229%	1.228%	1.227%	1.232%
コール市場残高	121,506	125,993	126,980	127,355	132,467
うち無担	99,253	103,277	103,463	104,179	109,030
うちO/N	32,519	36,853	35,914	35,340	39,831
うち有担	22,253	22,716	23,517	23,176	23,437

●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）
5年利付国債	189	2.2%	25,000	2026/11/13	2031/9/20	69,646	18,972	100.04	2.190%	15.0907%	100.06	2.186%	6,024	
国有林野借入	−	−	651	2026/11/25	2031/11/25	1,393	651		2.220%	24.0567%		2.163%		

●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)		2026/11/12	2026/11/13		0.800	838	838		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/11/12	2026/11/13		0.800	0	0				

●2026年11月13日の予定

*国庫短期証券(1419回)入札
（3ヶ月、31,000億円、11/16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