Central Daily Market Report

2026年11月13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13日 需給速報	2026年11月16日 需給予想	2026年11月17日 当社予想
銀行券	200	200	200
財政	▲ 14,800	▲ 100	▲ 4,000
資金過不足	▲ 14,600	100	▲ 3,800
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			
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 400 / 800	400	
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	▲ 14,200	500	▲ 3,800
当座預金残高	4,131,700	4,132,200	4,128,400
準備預金残高	3,791,000		
積み終了先	3,791,000	11月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,791,000	積数	4,032,800
非準備預金先	340,700	1日平均	134,400
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 2.99%	日数	0.00%

●2026年11月13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。マイクロソフト365の大規模障害の影響から、一部参加者が資金調達を見合わせた。
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>
13日はTDB3M物（第1419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。

<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

11/13	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	1.250	1.229	1W			1.310			T+0	1.250
T/N			1.200	2W	1.210	1.350	1.268			T+1	1.250
S/N				3W							
2日				1M						1W	1.250
3日				2M						2W	1.250
4日			1.305	3M			1.630			3W	1.250
5日				4M						1M	1.251
6日				5M				3M	1.270	3M	1.372
有担保コール（速報）				6M				6M	1.420	6M	1.450
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.600	1Y	1.647

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
2.855	+0.065	61,142.35	+322.99	159.88-90	159.84-86

日付	11/6	11/9	11/10	11/11	11/12
日銀当預残	4,128,200	4,134,700	4,136,200	4,127,000	4,145,900
準備預金残	3,799,000	3,798,900	3,790,900	3,791,900	3,811,600
マネタリーベース	5,315,400	5,321,600	5,322,700	5,313,300	5,332,100
無担O/N加重平均	1.229%	1.228%	1.227%	1.232%	1.227%
コール市場残高	125,993	126,980	127,355	132,467	128,367
うち無担	103,277	103,463	104,179	109,030	105,138
うちO/N	36,853	35,914	35,340	39,831	35,679
うち有担	22,716	23,517	23,176	23,437	23,229

●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	1419	－	31,000	2026/11/16	2027/2/22	93,350	23,927.6	99.6575	1.2800%	60.7960%	99.6598	1.2713%	7,072	

●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）		2026/11/13	2026/11/16		0.800	403	403		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/13	2026/11/16		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。

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
被災地金融支援オペ	第34回	2026/11/17	2027/11/17	1.25%	0

●2026年11月16日の予定

*7-9月期のGDP1次速報(内閣府 8:50)
*高田審議委員講演(徳島同友会 13:00)
*10月の業態別日銀当座預金残高(日銀 17:00)
*10年物価連動国債
（2,500億円、11/17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