Central Daily Market Report

2026年11月17日（火）
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17日 需給速報	2026年11月18日 需給予想	2026年11月19日 当社予想
銀行券	100	▲ 600	100
財政	▲ 7,700	▲ 16,900	▲ 1,000
資金過不足	▲ 7,600	▲ 17,500	▲ 900

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	▲ 900	2,000		900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 6,500		▲ 16,600		▲ 900	

当座預金残高	4,133,800	4,117,200	4,116,300
準備預金残高	3,776,700		
積み終了先	3,480,000	11月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,824,500	積数	282,500
非準備預金先	357,100	1日平均	10,100
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 92.99%	日数	6.67%

●2026年11月17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、出合いの水準は1.227～1.228%程度と横ばいで推移した。ターム物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>
17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、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

11/17	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		売買参考統計値		平均値	
O/N	1.203	1.280	1.227	1W	1.220	1.230	1.225	
T/N				2W	1.228	1.300	1.231	
S/N				3W				
2日				1M				
3日				2M			1.550	
4日				3M				
5日				4M				
6日	1.233	1.350	1.317	5M				
有担保コール（速報）				6M				
翌日物			1.180	1Y				

短国		東京レポレート	
		T+0	1.250
		T+1	1.250
		1W	1.250
		2W	1.250
		3W	1.250
		1M	1.252
3M	1.270	3M	1.384
6M	1.420	6M	1.458
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
2.880	▲ 0.004	58,860.43	▲ 801.59	159.51-53	159.33-35

日付	11/10	11/11	11/12	11/13	11/16
日銀当預残	4,136,200	4,127,000	4,145,900	4,131,700	4,140,300
準備預金残	3,790,900	3,791,900	3,811,600	3,781,300	3,791,800
マネタリーベース	5,322,700	5,313,300	5,332,100	5,317,900	5,326,200
無担O/N加重平均	1.227%	1.232%	1.227%	1.229%	1.228%
コール市場残高	127,355	132,467	128,367	129,186	127,395
うち無担	104,179	109,030	105,138	105,756	103,596
うちO/N	35,340	39,831	35,679	36,127	35,207
うち有担	23,176	23,437	23,229	23,430	23,799

●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）
交付税特会	－	－	12,000	2026/11/26	2027/5/27	44,003	11,999.99		1.600%	68.5859%		1.588%		―

●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
米ドル資金供給		2026/11/19	2026/11/27	4.130		1	1				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/11/17	2026/11/18		0.800	822	822		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/17	2026/11/18		0.800	112	112		0.800	0.800	

※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18日の予定

*10月の貿易統計(財務省 8:50)
*9月の石油等消費動態統計(エネ庁 13:30)
*米FOMC議事要旨
*国庫短期証券(1420回)入札
（1年、19,000億円、11/20発行）
*20年利付国債入札
（7,000億円、11/19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