Central Daily Market Report

2026年11月18日（水）
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18日 需給速報	2026年11月19日 需給予想	2026年11月20日 当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 600	▲ 300
財政	▲ 21,600	▲ 12,800	17,000
資金過不足	▲ 22,200	▲ 13,400	16,700

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	▲ 100	900		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 21,400		▲ 13,300		16,700	

当座預金残高	4,112,400	4,099,100	4,115,800
準備預金残高	3,759,400		
積み終了先	3,710,400	11月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,610,100	積数	133,200
非準備預金先	353,000	1日平均	4,900
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 96.70%	日数	10.00%

●2026年11月18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>
18日はTDB1Y物（第1420回）の入札が実施され、予想対比でやや甘い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは小甘く推移した。

<CP市場>
CP発行市場は五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施され、一部の業態で大型発行も見られた。
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

11/18	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	1.275	1.227	1W	1.220	1.241	1.229			T+0	1.250
T/N				2W	1.330	1.400	1.359			T+1	1.250
S/N				3W							
2日				1M			1.650			1W	1.250
3日				2M						2W	1.250
4日				3M						3W	1.250
5日				4M						1M	1.252
6日				5M				3M	1.270	3M	1.385
有担保コール（速報）				6M				6M	1.420	6M	1.460
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.650	1Y	1.653

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
2.870	▲ 0.010	59,024.28	+163.85	159.48-50	159.34-36

日付	11/11	11/12	11/13	11/16	11/17
日銀当預残	4,127,000	4,145,900	4,131,700	4,140,300	4,133,800
準備預金残	3,791,900	3,811,600	3,781,300	3,791,800	3,779,000
マネタリーベース	5,313,300	5,332,100	5,317,900	5,326,200	5,319,600
無担O/N加重平均	1.232%	1.227%	1.229%	1.228%	1.227%
コール市場残高	132,467	128,367	129,186	127,395	125,535
うち無担	109,030	105,138	105,756	103,596	101,736
うちO/N	39,831	35,679	36,127	35,207	34,877
うち有担	23,437	23,229	23,430	23,799	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）
国庫短期証券	1420	－	19,000	2026/11/20	2027/11/22	56,637	14,672.8	98.363	1.6551%	41.8461%	98.371	1.6469%	4,327	
20年利付国債	198	3.8%	7,000	2026/11/19	2046/9/20	19,140	5,258	100.20	3.782%	64.9193%	100.49	3.756%	1,738	

●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）		2026/11/18	2026/11/19		0.800	84	84		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/18	2026/11/19		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19日の予定

*9月の機械受注統計(内閣府 8:50)
*実質輸出入の動向(日銀 16:00頃)
*交付税特会借入
（12,000億円、11/30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