Central Daily Market Report

2026年11月20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20日 需給速報	2026年11月24日 需給予想	2026年11月25日 当社予想
銀行券	▲ 700	▲ 600	▲ 200
財政	100	5,300	2,000
資金過不足	▲ 600	4,700	1,800
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			▲ 8,000
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	6,300		
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	▲ 200 / 100	200	
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	5,600	4,900	▲ 6,200
当座預金残高	4,101,600	4,106,500	4,100,300
準備預金残高	3,752,600		
積み終了先	3,744,000	11月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,733,300	積数	19,900
非準備預金先	349,000	1日平均	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 99.51%	日数	26.67%

●2026年11月20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>
20日はTDB3M物（第1421回）の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。その他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

11/20	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	1.228	1W	1.225	1.300	1.236		T+0	1.250
T/N	1.220	1.225	1.224	2W			1.231		T+1	1.250
S/N				3W						
2日				1M			1.480		1W	1.250
3日				2M			1.540		2W	1.250
4日				3M					3W	1.250
5日				4M					1M	1.261
6日	1.290	1.350	1.347	5M				3M 1.250	3M	1.396
有担保コール（速報）				6M				6M 1.425	6M	1.465
翌日物			1.180	1Y				1Y 1.640	1Y	1.655

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
2.784	▲ 0.036	56,436.65	▲ 3,007.56	159.71-73	159.19-20

日付	11/13	11/16	11/17	11/18	11/19
日銀当預残	4,131,700	4,140,300	4,133,800	4,112,400	4,096,000
準備預金残	3,781,300	3,791,800	3,779,000	3,759,800	3,747,800
マネタリーベース	5,317,900	5,326,200	5,319,600	5,298,800	5,283,000
無担O/N加重平均	1.229%	1.228%	1.227%	1.227%	1.228%
コール市場残高	129,186	127,395	125,535	126,173	126,668
うち無担	105,756	103,596	101,736	102,854	103,571
うちO/N	36,127	35,207	34,877	35,995	35,992
うち有担	23,430	23,799	23,799	23,319	23,097

●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	1421	－	31,000	2026/11/24	2027/3/1	87,885	23,928	99.6625	1.2742%	81.2000%	99.6658	1.2617%	7,072	
流動性供給	465	－	7,000	2026/11/24	－	25,568	6,991		▲0.017%	72.5368%		▲0.020%		

●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）		2026/11/20	2026/11/24		0.800	234	234		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/11/20	2026/11/24		0.800	0	0				

●2026年11月24日の予定

*10月のFSBレポ統計(日銀 8:50)
*9月のサービス産業動態速報(総務省 8:30)

◆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