Central Daily Market Report

2026年10月15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10月15日 需給速報	2026年10月16日 需給予想	2026年10月19日 当社予想
銀行券	0	400	100
財政	64,800	▲ 100	3,000
資金過不足	64,800	300	3,100

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				▲ 200		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	64,600		400		3,100	

当座預金残高	4,159,700	4,160,100	4,163,200
準備預金残高	3,857,500		
積み終了先	3,857,500	10月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,857,500	積数	4,163,000
非準備預金先	302,200	1日平均	134,300
積み期間（10/16～11/15日）の所要準備額（積数）			4,163,000
準備預金進捗率	実績 0.00%	日数	0.00%

●2026年10月15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>
15日のアウトライト市場は、3M物と6M物で出合いが見られた。

<CP市場>
CP発行市場は、複数の入札が実施された。
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

10/15	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	1.280	1.228	1W	1.225	1.310	1.230		T+0	1.250
T/N				2W	1.288	1.360	1.315		T+1	1.250
S/N				3W						
2日			1.300	1M					1W	1.250
3日				2M					2W	1.250
4日				3M	1.480	1.500	1.484		3W	1.250
5日				4M					1M	1.254
6日				5M				3M 1.289	3M	1.317
有担保コール（速報）				6M				6M 1.395	6M	1.443
翌日物			1.180	1Y				1Y 1.600	1Y	1.644

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
2.920	▲ 0.075	64,425.95	▲ 3,318.34	157.96-98	157.86-88

日付	10/7	10/8	10/9	10/13	10/14
日銀当預残	4,084,800	4,087,600	4,082,100	4,098,300	4,095,100
準備預金残	3,757,300	3,759,200	3,769,500	3,782,500	3,784,100
マネタリーベース	5,270,700	5,273,600	5,268,300	5,284,400	5,280,500
無担O/N加重平均	1.227%	1.228%	1.227%	1.228%	1.228%
コール市場残高	140,485	140,450	138,364	138,749	135,189
うち無担	117,489	117,117	115,507	115,689	112,512
うちO/N	52,215	49,383	48,068	47,425	44,258
うち有担	22,996	23,333	22,857	23,060	22,677

●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	2026/10/23	2027/4/23	47,804	11,999.99		1.540%	81.3399%		1.526%		―

●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）		2026/10/15	2026/10/16		0.800	419	419		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/10/15	2026/10/16		0.800	21	21		0.800	0.800	

●2026年10月16日の予定

*植田総裁挨拶(内田副総裁代読　全国信用組合大会 15:30)
*9月のユーロ圏消費者物価指数改定値
*国庫短期証券(1413回)入札（3ヶ月、33,000億円、10/19発行）
*9月の業態別日銀当座預金残高(日銀 17:00)

◆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