

●資金需給

単位：億円	2026年10月16日 需給速報		2026年10月19日 需給予想		2026年10月20日 当社予想	
銀行券	400		0		0	
財政	▲ 1,900		9,100		12,500	
資金過不足	▲ 1,500		9,100		12,500	
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			3,700			
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	300		300		
※下ろし資金供給用担保関係供給						
当預増減	▲ 1,700		13,100		12,500	
当座預金残高	4,158,000		4,171,100		4,183,600	
準備預金残高	3,851,900					
積み終了先	3,793,500				10月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,505,600				積数	124,200
非準備預金先	306,100				1日平均	4,400
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	97.02%	日数	9.68%	

●2026年10月16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＞
16日はTDB3M物(第1413回)の入札が実施され、事前予想対比で強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。
この他、6M物でも出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。
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

10/16	無担保コール(速報)							短国		東京レポレート	JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)		
単位: %	最低	最高	平均		最低	最高	平均	売買参考統計値		平均値		直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
O/N	1.200	1.250	1.227	1W	1.225	1.360	1.267		T+0	1.250		2.930	+0.010	65,324.29	+898.34	158.13-14	158.00-02
T/N				2W	1.300	1.370	1.343		T+1	1.250							
S/N				3W													
2日				1M					1W	1.250							
3日				2M					2W	1.250							
4日				3M					3W	1.250							
5日				4M				1M	1.254								
6日				5M				3M	1.260		3M	1.319					
有担保コール(速報)				6M				6M	1.404		6M	1.443					
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.600		1Y	1.645					
日付																	
			10/8	10/9	10/13	10/14	10/15										
日銀当預残			4,087,600	4,082,100	4,098,300	4,095,100	4,159,700										
準備預金残			3,759,200	3,769,500	3,782,500	3,784,100	3,857,500										
マネタリーベース			5,273,600	5,268,300	5,284,400	5,280,500	5,345,100										
無担O/N加重平均			1.228%	1.227%	1.228%	1.228%	1.228%										
コール市場残高			140,450	138,364	138,749	135,189	134,160										
うち無担			117,117	115,507	115,689	112,512	111,662										
うちO/N			49,383	48,068	47,425	44,258	43,468										
うち有担			23,333	22,857	23,060	22,677	22,498										

●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1413	-	33,000	2026/10/19	2027/1/25	108,691	25,290.8	99.6560	1.2856%	17.7954%	99.6574	1.2803%	7,709	

●オペ結果

種類	オファ額(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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,900	2026/10/19				5,819	2,904	0.019		0.021	76.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	850	2026/10/19				2,375	851	0.033		0.038	40.0
国債買入(残存期間25年超)	750	2026/10/19				2,392	752	0.018		0.023	67.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/10/16	2026/10/19		0.800	383	383		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/16	2026/10/19		0.800	0	0				

●2026年10月19日の予定

*国庫短期証券(1414回)入札 (1年、22,000億円、10/20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