

●資金需給

単位：億円	2026年10月20日 需給速報		2026年10月21日 需給予想		2026年10月22日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 400		▲ 300	
財政	10, 800		▲ 13, 100		7, 000	
資金過不足	10, 700		▲ 13, 500		6, 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				▲ 200		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 400	300		400		
※下ろし資金供給用国債国債供給						
当預増減	10, 600		▲ 13, 300		6, 700	
当座預金残高	4, 184, 000		4, 170, 700		4, 177, 400	
準備預金残高	3, 865, 500		10月21日以降の残り所要積立額			
積み終了先	3, 843, 000					
超過準備	3, 841, 800					
非準備預金先	318, 500					
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	98.36%	日数	16.13%		

●2026年10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たことで、1.227~1.228%程度で推移した。
一部で高めの出会いが見られたが、影響は限定的となった。
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%程度のお合いとなった。
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日のアウトライト市場は、特段のお合いは見られなかった。

＜CP市場＞
CP発行市場は複数の業態で発行が観測された。
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

10/20	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	1.201	1.280	1.228	1W	1.225	1.310	1.232			T+0	1.250	2.895	▲ 0.009	64,075.42	▲ 841.28	158.52-53	158.07-09
T/N			1.215	2W	1.228	1.290	1.230			T+1	1.250						
S/N				3W													
2日				1M						1W	1.250						
3日			1.280	2M						2W	1.250						
4日				3M	1.510	1.520	1.513			3W	1.250						
5日				4M						1M	1.255						
6日			1.350	5M				3M	1.240	3M	1.325						
有担保コール(速報)				6M				6M	1.400	6M	1.442						
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.630	1Y	1.646						
										日付		10/13	10/14	10/15	10/16	10/19	
日銀当預残												4,098,300	4,095,100	4,159,700	4,158,000	4,173,400	
準備預金残												3,782,500	3,784,100	3,857,500	3,851,900	3,870,500	
マネタリーベース												5,284,400	5,280,500	5,345,100	5,343,100	5,358,400	
無担O/N加重平均												1.228%	1.228%	1.228%	1.227%	1.227%	
コール市場残高												138,749	135,189	134,160	130,232	128,555	
うち無担												115,689	112,512	111,662	107,455	104,591	
うちO/N												47,425	44,258	43,468	39,991	35,307	
うち有担												23,060	22,677	22,498	22,777	23,964	

●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)
20年利付国債	198	3.8%	7,000	2026/10/21	2046/9/20	31,390	5,371	100.80	3.729%	79.7613%	100.87	3.723%	1,628	

●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		2026/10/22	2026/10/29	4.130		2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/10/20	2026/10/21		0.800	382	382		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/20	2026/10/21		0.800	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2026/10/21	2026/10/30		1.220	2	2		1.220	1.220	

●2026年10月21日の予定

*9月の貿易統計(財務省 8:50)

◆本資料は信頼できるとさ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