Central Daily Market Report

2026年10月26日（月）
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26日 需給速報	2026年10月27日 需給予想	2026年10月28日 当社予想
銀行券	▲ 200	▲ 100	100
財政	100	1,400	▲ 4,000
資金過不足	▲ 100	1,300	▲ 3,900

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						
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	200		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	0		1,400		▲ 11,900	

当座預金残高	4,183,000	4,184,400	4,172,500
準備預金残高	3,856,000		
積み終了先	3,853,500	10月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,853,500	積数	2,900
非準備預金先	327,000	1日平均	100
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	99.93%	日数 35.48%

●2026年10月26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>
26日のアウトライト市場は、3M物で出合いが見られた。

<CP市場>
CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

10/26	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	1.202	1.228	1.227	1W					T+0	1.250
T/N			1.220	2W	1.225	1.231	1.229		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			1.600		1M	1.253
6日			1.350	5M				3M 1.250	3M	1.330
有担保コール（速報）				6M				6M 1.390	6M	1.440
翌日物			1.180	1Y				1Y 1.600	1Y	1.645

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
2.780	▲ 0.015	62,189.65	▲ 503.51	156.83-84	157.12-14

日付	10/19	10/20	10/21	10/22	10/23
日銀当預残	4,173,400	4,184,000	4,170,800	4,181,200	4,183,000
準備預金残	3,870,500	3,865,500	3,857,600	3,864,200	3,860,500
マネタリーベース	5,358,400	5,369,100	5,356,300	5,367,400	5,369,700
無担O/N加重平均	1.227%	1.228%	1.227%	1.227%	1.227%
コール市場残高	128,555	129,863	129,281	126,900	123,899
うち無担	104,591	105,691	105,528	104,063	101,592
うちO/N	35,307	36,777	36,309	35,534	32,893
うち有担	23,964	24,172	23,753	22,837	22,307

●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)	第Ⅰ非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。														

●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）		2026/10/26	2026/10/27		0.800	128	128		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/10/26	2026/10/27		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10月27日の予定

*9月の消費者物価のコア指標(日銀 14:00)
*9月の企業向けサービス（日銀 8:50）
*米FOMC(1日目)
*9月の米新築住宅販売件数
*流動性供給
（2,500億円、10/28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