Central Daily Market Report

2026年10月29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29日 需給速報	2026年10月30日 需給予想	2026年11月2日 当社予想
銀行券	▲ 600	100	▲ 300
財政	4,000	▲ 4,500	▲ 8,000
資金過不足	3,400	▲ 4,400	▲ 8,300

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	6,000					
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 400	300		400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	9,200		▲ 4,000		▲ 8,300	

当座預金残高	4,189,700	4,185,700	4,177,400
準備預金残高	3,867,800		
積み終了先	3,867,700	10月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,867,700	積数	600
非準備預金先	321,900	1日平均	0
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 99.99%	日数	45.16%

●2026年10月29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>
29日はTDB3M物（第1416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。

<CP市場>
CP発行市場は、複数の発行が観測された。
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

10/29	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	1.203	1.228	1.227	1W	1.227	1.310	1.239		T+0	1.248
T/N				2W	1.228	1.360	1.268		T+1	1.250
S/N				3W						
2日				1M	1.290	1.650	1.364		1W	1.250
3日				2M					2W	1.250
4日				3M			1.550		3W	1.250
5日	1.227	1.230	1.228	4M					1M	1.253
6日			1.279	5M				3M 1.235	3M	1.341
有担保コール（速報）				6M				6M 1.370	6M	1.446
翌日物			1.180	1Y				1Y 1.625	1Y	1.649

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
2.835	+0.010	64,659.47	+705.28	157.82-84	157.82-83

日付	10/22	10/23	10/26	10/27	10/28
日銀当預残	4,181,200	4,183,000	4,183,000	4,182,700	4,180,500
準備預金残	3,864,200	3,860,500	3,856,300	3,861,700	3,863,200
マネタリーベース	5,367,400	5,369,700	5,370,000	5,369,800	5,367,700
無担O/N加重平均	1.227%	1.227%	1.227%	1.227%	1.227%
コール市場残高	126,900	123,899	124,274	124,736	123,193
うち無担	104,063	101,592	101,588	101,633	101,398
うちO/N	35,534	32,893	33,739	33,489	33,424
うち有担	22,837	22,307	22,686	23,103	21,795

●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	1416	－	33,000	2026/11/2	2027/2/8	98,032	25,296.8	99.6585	1.2762%	47.7590%	99.6600	1.2706%	7,703	
2年利付国債	490	1.9%	28,000	2026/11/2	2028/11/1	85,392	21,184	99.975	1.912%	83.6544%	99.989	1.905%	6,801	10.7

●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）		2026/10/29	2026/10/30		0.800	440	440		0.800	0.800	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/10/29	2026/10/30		0.800	0	0				

●2026年10月30日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目)
*経済・物価情勢の展望(展望レポート)
*10月の都区部消費者物価指数(CPI 総務省 8:30)
*9月の労働力調査(完全失業率 総務省 8:30)
*9月の有効求人倍率(厚労省 8:30)
*9月の鉱工業生産速報(経済産業省 8:50)
*7-9月期のユーロ圏GDP速報値
*7-9月期の米雇用コスト指数

◆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