Central Daily Market Report

2026年9月1日（火）
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9月1日 需給速報		2026年9月2日 需給予想		2026年9月3日 当社予想	
銀行券	500		100		▲ 300	
財政	▲ 54,600		▲ 28,000		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 54,100		▲ 27,900		▲ 4,300	
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			8,000	▲ 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		▲ 200		▲ 100		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 300	400		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 54,200		▲ 27,700		▲ 4,300	
当座預金残高	4,189,600		4,161,900		4,157,600	
準備預金残高	3,860,300					
積み終了先	3,860,200					
超過準備	3,860,200					
非準備預金先	329,300					

9月2日以降の残り所要積立額	
積数	500
1日平均	0

積み期間（8/16～9/15日）の所要準備額（積数）	4,169,900
準備預金進捗率　実績	99.99%
日数	41.46%

●2026年9月1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がニーズが見られたことで、0.977～0.978%程度で推移した。
ターム物では、幅広い期間で引き合いが見られた。

<レポ市場>
GC T/Nは、1.005%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>
1日のアウトライト市場は、1Y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

9/1	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	0.950	1.030	0.977	1W	0.981	1.060	1.014			T+0	0.999
T/N				2W	0.978	1.140	0.986			T+1	1.000
S/N			0.975	3W			1.065				
2日				1M	1.160	1.200	1.185			1W	1.000
3日				2M			1.300			2W	1.000
4日				3M	1.330	1.570	1.356			3W	1.000
5日				4M						1M	1.061
6日				5M				3M	1.010	3M	1.190
有担保コール（速報）				6M				6M	1.185	6M	1.266
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.455	1Y	1.456

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
2.990	+0.050	66215.34	▲ 96.59	159.76-77	159.98-00

日付	8/25	8/26	8/27	8/28	8/31
日銀当預残	4,248,500	4,238,900	4,233,200	4,243,700	4,243,800
準備預金残	3,922,400	3,918,700	3,918,300	3,920,100	3,905,400
マネタリーベース	5,443,700	5,434,200	5,428,600	5,438,800	5,438,200
無担O/N加重平均	0.977%	0.978%	0.977%	0.977%	0.977%
コール市場残高	122,926	121,693	124,038	124,780	121,641
うち無担	100,591	99,713	102,250	102,596	99,952
うちO/N	35,502	35,284	36,441	37,503	35,950
うち有担	22,335	21,980	21,788	22,184	21,689

●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)
10年利付国債	383	2.7%	26,000	2026/9/2	2036/6/20	65,385	19,896	97.64	3.011%	29.5479%	97.76	2.995%	6,073	30.43

●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		2026/9/3	2026/9/10	3.880		0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/9/1	2026/9/2		0.500	329	329		0.500	0.500	
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2026/9/2	2026/9/16	1.000		20,225	8,010				39.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/9/1	2026/9/2		0.500	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9月2日の予定

*8月のマネタリーベース(日銀 8:50)
*高田日銀審議委員挨拶(札幌市金融経済懇談会 10:30)
*8月の米ADP雇用統計
*7月の米製造業新規受注
*米ベージュブック

◆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