

Central Daily Market Report

2026年9月2日(水)

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2日 需給速報	2026年9月3日 需給予想	2026年9月4日 当社予想
銀行券	100	200	500
財政	▲ 34,300	▲ 1,600	▲ 8,000
資金過不足	▲ 34,200	▲ 1,400	▲ 7,500
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出	スタート	エンド	スタート
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		4,700	
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	▲ 100
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 100	300	100
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	▲ 34,100	3,300	▲ 7,500
当座預金残高	4,155,500	4,158,800	4,151,300
準備預金残高	3,834,400		
積み終了先	3,834,300	9月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,834,300	積数	400
非準備預金先	321,100	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
			58.06%

●2026年9月2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必要が見られたことで、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>

2日のアウトライト市場は、特段の出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大型発行が実施され、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

9/2	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	0.950	1.030	0.977	1W	0.983	1.110	1.017		T+0	1.000	3.010	+0.020	64,325.64	▲ 1,889.70		160.20~21	159.69~71
T/N				2W					T+1	1.000							
S/N			0.975	3W	1.060	1.200	1.107										
2日				1M					1W	1.000							
3日				2M			1.370		2W	1.000							
4日				3M	1.350	1.380	1.365		3W	1.001							
5日				4M					1M	1.074							
6日				5M				3M	1.197								
有担保コール(速報)				6M				6M	1.185	6M	1.271						
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.480	1Y	1.468						
												日付	8/26	8/27	8/28	8/31	9/1
日銀当預残												4,238,900	4,233,200	4,243,700	4,243,800	4,189,600	
準備預金残												3,918,700	3,918,300	3,920,100	3,905,400	3,861,000	
マネタリーベース												5,434,200	5,428,600	5,438,800	5,438,200	5,383,600	
無担O/N加重平均												0.978%	0.977%	0.977%	0.977%	0.977%	
コール市場残高												121,693	124,038	124,780	121,641	127,307	
うち無担												99,713	102,250	102,596	99,952	103,274	
うちO/N												35,284	36,441	37,503	35,950	39,487	
うち有担												21,980	21,788	22,184	21,689	24,033	

●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)	第1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
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2026/9/3				4,534	1,002	0.022		0.028	60.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2026/9/3				12,363	3,200		0.046	0.047	
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2026/9/3				3,133	1,004	0.026		0.029	18.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/9/2	2026/9/3		0.500	146	146		0.500	0.461	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/2	2026/9/3		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3日の予定

*9月の日銀当座預金増減要因見込み(日銀 8:50)	*7月の米貿易収支 *8月のISM非製造業景況指数	*30年利付国債入札 (6,000億円、9/4発行) *交付税特会借入 (12,000億円、9/11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