

●資金需給

単位：億円	2026年9月15日 需給速報		2026年9月16日 需給予想		2026年9月17日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 700		300	
財政	▲ 7,300		2,400		0	
資金過不足	▲ 7,500		1,700		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						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 500	100		500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 7,900		2,200		300	
当座預金残高	4,089,500		4,091,700		4,092,000	
準備預金残高	3,777,500					
積み終了先	3,777,500				9月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,777,500				積数	4,028,000
非準備預金先	312,000				1日平均	134,300
積み期間（9/16～10/15日）の所要準備額（積数）					4,028,000	
準備預金進捗率	実績		0.00%		日数	0.00%

●2026年9月15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、出合いの水準は0.975～0.978%程度で推移した。ターム物では、引き続き月末越えの資金手当てを希望する先からの資金調達ニーズが散見された。

＜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＞

15日のアウトライト市場は、6M物で出合いが見られた。

＜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

9/15 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	0.978	1W	0.983	1.000	0.994		T+0	0.999	3.030	+0.045	63,484.10	▲ 8.89	154.41-43	154.88-90		
T/N				2W	1.060	1.250	1.083		T+1	1.000								
S/N				3W														
2日			1.100	1M					1W	1.000								
3日				2M	1.350	1.390	1.384		2W	1.102								
4日				3M					3W	1.148								
5日				4M					1M	1.187								
6日				5M				3M	1.259									
有担保コール(速報)				6M				6M	1.330	6M	1.366							
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.530	1Y	1.541							
												日付		9/8	9/9	9/10	9/11	9/14
												日銀当預残		4,151,800	4,116,600	4,127,100	4,117,300	4,097,400
												準備預金残		3,835,800	3,811,200	3,809,700	3,805,300	3,788,900
												マネタリーベース		5,343,200	5,307,300	5,317,700	5,307,400	5,287,600
												無担O/N加重平均		0.977%	0.977%	0.977%	0.977%	0.977%
												コール市場残高		127,935	128,237	129,985	131,320	131,714
												うち無担		104,696	105,234	106,124	107,188	107,898
												うちO/N		39,729	39,777	40,837	42,491	43,211
												うち有担		23,239	23,003	23,861	24,132	23,816

●入札結果

名称	回数	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非償額争入札(億円)	非競争入札(億円)
20年利付国債	197	3.7%	7,000	2026/9/16	2046/6/20	21,313	5,321	98.10	3.869%	52.2388%	98.25	3.856%	1,674	

●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		2026/9/17	2026/10/1	4.100		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/9/15	2026/9/16		0.500	497	497		0.500	0.500	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2026/9/16	2026/9/30	1.000		56,893	8,027				14.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/15	2026/9/16		0.500	0	0				

●2026年9月16日の予定

*8月の貿易統計(財務省 8:50)	*8月の米小売売上高	*国庫短期証券(1407回)入札
*7月の機械受注(内閣府 8:50)	*米FOMC(2日目・経済見通し)	(1年・25,000億円・9/24発行)
*8月の業態別日銀当座預金残高(日銀 17:00)	*7月の対米証券投資	

◆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