

●資金需給

単位：億円		2026年9月16日 需給速報		2026年9月17日 需給予想		2026年9月18日 当社予想	
銀行券		▲ 700		▲ 1,300		1,000	
財政		1,500		6,900		▲ 2,000	
資金過不足		800		5,600		▲ 1,000	
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				6,800			
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							
国債補充供給		▲ 300	500		300		
※下ろし資金供給用担保国債供給							
当預増減		1,000		12,700		▲ 1,000	
当座預金残高		4,090,500		4,103,200		4,102,200	
準備預金残高		3,781,800					
積み終了先		1,235,400				9月17日以降の残り所要積立額	
超過準備		925,300				積数 1,171,500	
非準備預金先		308,700				1日平均 40,400	
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 70.92%		日数 3.33%			

●2026年9月16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＞
16日はTDB1Y物(第1407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

9/16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	1.025	0.977	1W	0.983	1.110	1.017		T+0	1.000	2.995	▲ 0.035	63,923.00	+438.90	155.28~30	154.97~99	
T/N				2W			1.490		T+1	1.000							
S/N				3W													
2日				1M					1W	1.000							
3日				2M					2W	1.119							
4日				3M					3W	1.161							
5日				4M					1M	1.195							
6日				5M					3M	1.262							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.330	6M	1.371						
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.570	1Y	1.549						

●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)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1407	-	25,000	2026/9/24	2027/9/21	91,714.6	19,168.9	98.449	1.5884%	4.5263%	98.462	1.5749%	5,831	

●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3年超5年以下)	3,200	2026/9/17				5,266	3,202	▲0.022		▲0.016	34.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,350	2026/9/17				4,742	3,351	▲0.030		▲0.018	89.1
国債買入(残存期間25年超)	750	2026/9/17				1,385	751	▲0.014		0.010	47.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/9/16	2026/9/17		0.500	326	326		0.500	0.500	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/16	2026/9/17		0.500	0	0				

●2026年9月17日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目)	*8月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(1408回)入札
*4-6月期の資金循環統計速報(日銀 8:50)	*英中銀MPC(政策金利発表)	(3ヶ月、35,000億円、9/24発行)</