

Central Daily Market Report

2026年9月18日(金)
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18日 需給速報		2026年9月24日 需給予想		2026年9月25日 当社予想	
銀行券	▲ 1,100		800		▲ 100	
財政	2,600		87,000		▲ 2,000	
資金過不足	1,500		87,800		▲ 2,100	
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						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 1,300				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 300	400		300		
※下ろし資金供給用国債提供供給						
当預増減	300		88,100		▲ 2,100	
当座預金残高	4,103,000		4,191,100		4,189,000	
準備預金残高	3,810,900		9月24日以降の残り所要積立額 積数 23,000 1日平均 1,000			
積み終了先	3,800,200					
超過準備	3,768,200					
非準備預金先	292,100					
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	99.43%	日数	26.67%		

●2026年9月18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、六日積みであることから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、1.255%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>

18日のアウトライト市場は、3M物と1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

9/18	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	0.940	0.978	0.977	1W	1.226	1.232	1.227		T+0	0.998	2.975	▲ 0.015	65,018.95	+882.70	156.15-17	157.48-50
T/N				2W	1.350	1.490	1.420		T+1	1.249						
S/N			1.210	3W												
2日				1M	1.350	1.680	1.422		1W	1.249						
3日				2M					2W	1.249						
4日				3M					3W	1.249						
5日			1.225	4M				1M	1.250							
6日	1.300	1.365	1.348	5M				3M	1.210	3M	1.284					
有担保コール(速報)				6M				6M	1.345	6M	1.386					
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.565	1Y	1.572					
JGB新発10年債(%)																
日付		9/11		9/14		9/15		9/16		9/17						
日銀当預残		4,117,300		4,097,400		4,089,500		4,090,500		4,102,700						
準備預金残		3,805,300		3,788,900		3,777,500		3,782,700		3,802,800						
マネタリーベース		5,307,400		5,287,600		5,280,000		5,281,700		5,295,200						
無担O/N加重平均		0.977%		0.977%		0.978%		0.977%		0.977%						
コール市場残高		131,320		131,714		134,843		134,782		131,250						
うち無担		107,188		107,898		110,534		110,717		107,403						
うちO/N		42,491		43,211		46,177		46,290		43,916						
うち有担		24,132		23,816		24,309		24,065		23,847						

金融市場調節方針の変更について

- 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した(賛成7反対2)。
無担保コールレート(オーバーナイト物)を、1.25%程度で推移するよう促す。
- 上記の金融市場調節方針の変更に伴い、以下のとおり、各種制度の適用利率の変更を決定した(賛成7反対2)。
(1) 補完当座預金制度の適用利率
補完当座預金制度の適用利率(日本銀行当座預金<所要準備額相当部分を除く>への付利金利)については、1.25%とする。
(2) 基準貸付利率
補完貸付制度については、その適用金利である基準貸付利率を1.5%とする。
- 気候変動対応オペについて、金融調節の円滑な運営を確保しつつ、民間における気候変動対応を安定的に支援する観点から、貸付金利を変動金利に変更するほか、貸付総額等に上限を設定することとした(全員一致)。

●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)		2026/9/18	2026/9/24		0.500	369	369		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/18	2026/9/24		0.500	0	0				

●2026年9月21日の予定

*敬老の日

●2026年9月22日の予定

*国民の休日

●2026年9月23日の予定

*秋分の日

●2026年9月24日の予定

*8月のFSBレポ統計の日本分集計結果(日銀 8:50)

*4-6月期の米経常収支

*8月の米新築住宅販売件数

◆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