

●資金需給

単位：億円	2026年9月28日 需給速報		2026年9月29日 需給予想		2026年9月30日 当社予想							
銀行券	900		700		800							
財政	2,400		▲ 10,000		▲ 2,000							
資金過不足	3,300		▲ 9,300		▲ 1,200							
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						
国債買現												
国債売現												
国庫短期証買入												
国債買入			4,500									
貸出支援基金(貸)												
被災地支援												
社債等買入				▲ 100								
気候変動対応オペ												
国債補完供給	▲ 400	500		400								
※ 下丸資金供給用国債国債供給												
当預増減	3,400		▲ 4,500		▲ 9,200							
当座預金残高	4,179,800		4,175,300		4,166,100							
準備預金残高	3,869,900		<table><tr><td colspan="2">9月29日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>2,000</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>100</td></tr></table>				9月29日以降の残り所要積立額		積数	2,000	1日平均	100
9月29日以降の残り所要積立額												
積数	2,000											
1日平均	100											
積み終了先	3,869,200											
超過準備	3,869,200											
非準備預金先	309,900											
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	99.95%	日数	43.33%								

●2026年9月28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1.225～1.228%程度で推移した。ターム物では、幅広い期間での引き合いが見受けられた。

＜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＞
28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、大型発行を含め、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。

●短期金融市場関連指標

9/28	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	1.200	1.228	1.227	1W			1.220		T+0	1.250		3.085	+0.010	65,877.62	▲ 486.58	157.42-45	157.22-24		
T/N				2W	1.221	1.231	1.227		T+1	1.250									
S/N			1.400	3W															
2日				1M			1.350		1W		1.250								
3日				2M			1.410		2W		1.250								
4日				3M			1.490		3W		1.250								
5日				4M					1M		1.251								
6日				5M				3M	1.260		3M	1.303							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.404		6M	1.409							
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.625		1Y	1.604							
日付 9/16 9/17 9/18 9/24 9/25 日銀当預残 4,090,500 4,102,700 4,103,000 4,182,100 4,176,400 準備預金残 3,782,700 3,802,800 3,809,000 3,873,200 3,873,200 マネタリーベース 5,281,700 5,295,200 5,296,600 5,375,000 5,367,300 無担O/N加重平均 0.977% 0.977% 0.977% 1.227% 1.227% コール市場残高 134,782 131,250 132,180 130,175 136,883 うち無担 110,717 107,403 106,150 103,048 113,507 うちO/N 46,290 43,916 44,254 45,888 52,322 うち有担 24,065 23,847 26,030 27,127 23,376																			

●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)	第Ⅰ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年超3年以下)	3,550	2026/9/29				10,199	3,554	0.035		0.036	62.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2026/9/29				3,816	1,003	0.015		0.018	29.5
国債買入(物価連動債)	300	2026/9/29				1,481	300	▲0.730		▲0.767	84.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/9/28	2026/9/29		0.800	445	445		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/28	2026/9/29		0.800	0	0				

●2026年9月29日の予定

*7月の米ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(3,000億円、9/30発行)
*9月の米CB消費者信頼感指数	

◆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の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