

●資金需給

単位：億円	2026年9月30日 需給速報		2026年10月1日 需給予想		2026年10月2日 当社予想		
銀行券	1,000		100		100		
財政	▲ 8,000		▲ 26,400		▲ 47,000		
資金過不足	▲ 7,000		▲ 26,300		▲ 46,900		
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	▲ 1,000	200		1,000			
※下付資金供給用担保国債供給							
当預増減	▲ 7,800		▲ 25,300		▲ 46,900		
当座預金残高	4,166,500		4,141,200		4,094,300		
準備預金残高	3,849,700						
積み終了先	3,849,500				10月1日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,849,500				積数		900
非準備預金先	316,800				1日平均		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		99.98%		日数		50.00%

●2026年9月30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、四半期末要因で一部取り手がビッドを控えたものの、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＞
30日のアウトライト市場は、3M物と、6M物と、1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数の発行が観測された。
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

9/30	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	1.190	1.229	1.226	1W	1.220	1.232	1.225			T+0	1.247	3.060	▲ 0.025	66,753.72	+1,272.45	157.41-43	156.90-92	
T/N	1.280	1.380	1.365	2W						T+1	1.250							
S/N				3W														
2日				1M	1.240	1.370	1.329			1W	1.250							
3日				2M			1.400			2W	1.250							
4日				3M			1.480			3W	1.250							
5日				4M						1M	1.251							
6日			1.225	5M				3M	1.285	3M	1.313							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.395	6M	1.427							
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.640	1Y	1.624							
												日付		9/18	9/24	9/25	9/28	9/29
												日銀当預残		4,103,000	4,182,100	4,176,400	4,179,800	4,174,300
												準備預金残		3,809,000	3,873,200	3,873,200	3,869,900	3,863,000
												マネタリーベース		5,296,600	5,375,000	5,367,300	5,369,800	5,363,600
												無担O/N加重平均		0.977%	1.227%	1.227%	1.227%	1.227%
												コール市場残高		132,180	130,175	136,883	135,310	136,899
												うち無担		106,150	103,048	113,507	113,002	114,777
												うちO/N		44,254	45,888	52,322	53,807	55,072
												うち有担		26,030	27,127	23,376	22,308	22,122

●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非競争額・争入札(億円)	非競争入札(億円)
2年利付国債	489	2.0%	28,000	2026/10/1	2028/10/1	83,448	21,453	100.055	1.971%	39.3473%	100.069	1.964%	6,540	0.79

●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)		2026/9/30	2026/10/1		0.800	1,327	1,327		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/30	2026/10/1		0.800	0	0				

●2026年10月1日の予定

*金融政策決定会合における主な意見(9/17・18日分)	*9月のISM製造業景況指数	*交付税特会借入(12,000億円、10/9発行)
*9月調査の日銀短観(概要及び要旨)		
*日銀当座預金増減要因と金融調節(9月実績)		

◆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