

●資金需給

単位：億円	2026年10月1日 需給速報		2026年10月2日 需給予想		2026年10月5日 当社予想	
銀行券	100		400		600	
財政	▲ 27,500		▲ 45,200		3,000	
資金過不足	▲ 27,400		▲ 44,800		3,600	
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						
気候変動対応オペ						
国債補完供給		1,000				
※下ろし資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 26,400		▲ 44,800		3,600	
当座預金残高	4,140,100		4,095,300		4,098,900	
準備預金残高	3,828,000		10月2日以降の残り所要積立額			
積み終了先	3,827,800	積数			800	
超過準備	3,827,800	1日平均			100	
非準備預金先	312,100					
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	53.33%	

●2026年10月1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、四半期末要因が剥落したことにより、昨日より幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られ、出会いの水準は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%程度のお合いとなった。
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＞
1日のアウトライト市場は、1Y物で出会いが見られた。

＜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

10/1	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	1.280	1.227	1W	1.225	1.310	1.259		T+0	1.250		3.095	+0.035	68,956.72	+2,203.00	157.55~57	158.37~40
T/N			1.280	2W	1.300	1.380	1.348		T+1	1.250							
S/N				3W													
2日				1M	1.283	1.650	1.340		1W	1.250							
3日				2M					2W	1.250							
4日			1.220	3M			1.500		3W	1.250							
5日				4M					1M	1.251							
6日			1.233	5M				3M	1.280	3M	1.315						
有担保コール(速報)				6M				6M	1.385	6M	1.432						
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.635	1Y	1.631						
JGB新発10年債(%)																	
日経平均株価(円)																	
為替(ドル/円)																	
日付												9/24	9/25	9/28	9/29	9/30	
日銀当預残												4,182,100	4,176,400	4,179,800	4,174,300	4,166,500	
準備預金残												3,873,200	3,873,200	3,869,900	3,863,000	3,849,900	
マネタリーベース												5,375,000	5,367,300	5,369,800	5,363,600	5,354,700	
無担O/N加重平均												1.227%	1.227%	1.227%	1.227%	1.226%	
コール市場残高												130,175	136,883	135,310	136,899	122,357	
うち無担												103,048	113,507	113,002	114,777	100,363	
うちO/N												45,888	52,322	53,807	55,072	45,179	
うち有担												27,127	23,376	22,308	22,122	21,994	

●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)
交付税特会	-	-	12,000	2026/10/9	2027/4/9	48,250	12,000		1.525%	70.0000%		1.504%		-

●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)		2026/10/1	2026/10/2		0.800	74	74		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/1	2026/10/2		0.800	0	0				