

●資金需給

単位：億円	2026年10月2日 需給速報		2026年10月5日 需給予想		2026年10月6日 当社予想	
銀行券	500		900		500	
財政	▲ 45,400		9,300		1,000	
資金過不足	▲ 44,900		10,200		1,500	
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						
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 44,900		10,200		1,500	
当座預金残高	4,095,200		4,105,400		4,106,900	
準備預金残高	3,776,400					
積み終了先	3,776,300				10月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,776,300				積数	
非準備預金先	318,800				1日平均	
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		99.99%		日数	
					63.33%	

●2026年10月2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＞
2日はTDB3M物（第1410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

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	1.229	1.227	1W			1.360		T+0	1.250	3.100	+0.005	68,309.46	▲ 647.26		157.93-95	157.57-59
T/N				2W	1.233	1.234	1.233		T+1	1.250							
S/N				3W													
2日				1M	1.300	1.520	1.378		1W	1.250							
3日				2M			1.380		2W	1.250							
4日				3M					3W	1.250							
5日				4M					1M	1.252							
6日				5M					3M	1.265	3M	1.314					
有担保コール(速報)				6M				6M	1.385	6M	1.435						
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.620	1Y	1.635						
JGB新発10年債(%)																	
日経平均株価(円)																	
為替(ドル/円)																	
日付												9/25	9/28	9/29	9/30	10/1	
日銀当預残												4,176,400	4,179,800	4,174,300	4,166,500	4,140,100	
準備預金残												3,873,200	3,869,900	3,863,000	3,849,900	3,828,000	
マネタリーベース												5,367,300	5,369,800	5,363,600	5,354,700	5,328,200	
無担O/N加重平均												1.227%	1.227%	1.227%	1.226%	1.227%	
コール市場残高												136,883	135,310	136,899	122,357	137,372	
うち無担												113,507	113,002	114,777	100,363	114,789	
うちO/N												52,322	53,807	55,072	45,179	53,550	
うち有担												23,376	22,308	22,122	21,994	22,583	

●入札結果

名称	回数	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	1410	-	35,000	2026/10/5	2027/1/12	117,105	26,984.8	99.6520	1.2875%	13.2804%	99.6542	1.2793%	8,015	

●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)		2026/10/2	2026/10/5		0.800	78	78		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/2	2026/10/5		0.800	0	0				

●2026年10月5日の予定

*10月の日銀当座預金増減要因見込み(日銀 8:50)	*9月のISM非製造業景況指数	*交付税特会借入(12,000億円、10/16発行)
*需給ギャップ・潜在成長率(日銀 14:00)		

◆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