

●資金需給

単位：億円	2026年10月6日 需給速報		2026年10月7日 需給予想		2026年10月8日 当社予想	
銀行券	700		200		▲ 300	
財政	▲ 1,000		▲ 25,700		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 300		▲ 25,500		▲ 2,300	
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		100				
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 200		▲ 25,500		▲ 2,300	
当座預金残高	4,108,400		4,082,900		4,080,600	
準備預金残高	3,776,300				10月7日以降の残り所要積立額	
積み終了先	3,776,300					
超過準備	3,776,200					
非準備預金先	332,100					
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		99.99%		日数	70.00%

●2026年10月6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＞
6日のアウトライト市場は、6M物、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、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

10/6	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	1.350	1.230		T+0	1.250		3.095	+0.010	70,683.98	+737.12	157.95-98	158.10-13
T/N				2W			1.228		T+1	1.250							
S/N				3W							日付		9/29	9/30	10/1	10/2	10/5
2日				1M	1.335	1.350	1.343		1W	1.250		日銀当預残	4,174,300	4,166,500	4,140,100	4,095,200	4,108,600
3日				2M					2W	1.250		準備預金残	3,863,000	3,849,900	3,828,000	3,776,400	3,778,500
4日				3M			1.500		3W	1.250		マネタリーベース	5,363,600	5,354,700	5,328,200	5,282,800	5,295,300
5日				4M					1M	1.253		無担O/N加重平均	1.227%	1.226%	1.227%	1.227%	1.227%
6日				5M				3M	1.265	3M	1.314	コール市場残高	136,899	122,357	137,372	136,849	140,393
有担保コール(速報)				6M				6M	1.380	6M	1.436	うち無担	114,777	100,363	114,789	114,979	116,840
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.610	1Y	1.638	うちO/N	55,072	45,179	53,550	52,020	52,061
												うち有担	22,122	21,994	22,583	21,870	23,553

●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)
10年利付国債	384	3.1%	26,000	2026/10/7	2036/9/20	74,011	19,661	99.97	3.103%	71.1197%	99.99	3.101%	6,315	18.54

●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
米ドル資金供給		2026/10/8	2026/10/15	4.130		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/10/6	2026/10/7		0.800	25	25		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/6	2026/10/7		0.800	0	0				

※1. オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)、米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り。国債買現先の場合は、下限期間利回り。国債買入の場合は、下限利回較差。国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。

●2026年10月7日の予定

*9月のオペレーション(日銀 8:50)	*米FOMC議事要旨	*エネルギー対策借入(5,415億円、10/20発行)
*9月の日本銀行の対政府取引(日銀 8:50)		
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引(日銀 8:50)		
*8月の消費活動指数(日銀 14:00頃)		
*9月のコール市場残高(日銀 15:00)		

◆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、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何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