

●資金需給

単位：億円	2026年10月7日 需給速報		2026年10月8日 需給予想		2026年10月9日 当社予想	
銀行券	200		▲ 200		200	
財政	▲ 23,800		1,800		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 23,600		1,600		▲ 6,800	
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			4,900			
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						
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 23,600		6,400		▲ 6,800	
当座預金残高	4,084,800		4,091,200		4,084,400	
準備預金残高	3,757,300					
積み終了先	3,757,200				10月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,757,200				積数 200	
非準備預金先	327,500				1日平均 0	
積み期間（9/16～10/15日）の所要準備額（積数）					4,032,500	
準備預金進捗率	実績 100.00%		日数 73.33%			

●2026年10月7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、1.227~1.228%程度で推移した。
ターム物では、幅広い期間で引き合いが見られた。

＜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＞
7日のアウトライト市場は、1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

10/7	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	1.288	1.236		T+0	1.250		3.105	+0.010	70,035.71	▲ 648.27	158.31~33	158.10~11
T/N				2W	1.232	1.330	1.265		T+1	1.250							
S/N				3W			1.320										
2日				1M			1.400		1W	1.250							
3日				2M					2W	1.250							
4日				3M			1.500		3W	1.250							
5日				4M				1M	1.254								
6日	1.231	1.250	1.238	5M				3M	1.265		3M	1.315					
有担保コール(速報)				6M				6M	1.380		6M	1.440					
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.615		1Y	1.641					
		日付		9/30		10/1		10/2		10/5		10/6					
日銀当預残				4,166,500		4,140,100		4,095,200		4,108,600		4,108,400					
準備預金残				3,849,900		3,828,000		3,776,400		3,778,500		3,777,500					
マネタリーベース				5,354,700		5,328,200		5,282,800		5,295,300		5,294,500					
無担O/N加重平均				1.226%		1.227%		1.227%		1.227%		1.227%					
コール市場残高				122,357		137,372		136,849		140,393		137,351					
うち無担				100,363		114,789		114,979		116,840		114,454					
うちO/N				45,179		53,550		52,020		52,061		50,115					
うち有担				21,994		22,583		21,870		23,553		22,897					

●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非償付競争入札(億円)	非競争入札(億円)
エネルギー対策	-	-	5,415	2026/10/20	2027/10/20	21,420	5,415		1.763%	68.6658%		1.751%		

●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年以下)	1,000	2026/10/8				4,909	1,002	0.011		0.020	55.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,300	2026/10/8				8,031	3,303	0.006		0.007	61.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	850	2026/10/8				3,350	852	▲0.013		▲0.008	22.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/10/7	2026/10/8		0.800	79	79		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/7	2026/10/8		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8日の予定

*8月の国際収支(財務省所管・日銀作成 8:50) *地域経済報告(さくらレポート 日銀) *支店長会議における報告(日銀) *4~6月期の業種別・地域別直接投資(日銀 8:50)	*30年利付国債入札(6,000億円、10/9発行) *国庫短期証券(1411回)入札(6ヶ月、30,000億円、10/13発行)
---	--

◆本資料は信頼できるとさ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