

●資金需給

単位：億円	2026年10月8日 需給速報		2026年10月9日 需給予想		2026年10月13日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 200		▲ 500	
財政	▲ 1,600		▲ 5,000		14,000	
資金過不足	▲ 1,800		▲ 5,200		13,500	
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	4,900					
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 200		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	2,800		▲ 5,200		13,500	
当座預金残高	4,087,600		4,082,400		4,095,900	
準備預金残高	3,759,200					
積み終了先	3,759,200				10月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,759,200				積数	
非準備預金先	328,400				1日平均	
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	
					76.67%	

●2026年10月8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＞
8日はTDB6M物(第1411回)の入札が実施され、無難な結果となった。セカンダリーでは底堅く推移した。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数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

10/8	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	1.228	1W	1.225	1.310	1.230			T+0		1.249		3.080	▲ 0.025	69,042.11	▲ 993.60	158.09-11	158.18-19			
T/N				2W						T+1		1.250										
S/N				3W																		
2日				1M	1.300	1.320	1.316			1W		1.250										
3日				2M						2W		1.250										
4日				3M						3W		1.250										
5日				4M						1M		1.254										
6日	1.225	1.350	1.323	5M				3M	1.265	3M	1.316											
有担保コール(速報)				6M				6M	1.390	6M	1.442											
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.600	1Y	1.644											
日付																		10/1	10/2	10/5	10/6	10/7
日銀当預残																		4,140,100	4,095,200	4,108,600	4,108,400	4,084,800
準備預金残																		3,828,000	3,776,400	3,778,500	3,777,500	3,757,300
マネタリーベース																		5,328,200	5,282,800	5,295,300	5,294,500	5,270,700
無担O/N加重平均																		1.227%	1.227%	1.227%	1.227%	1.227%
コール市場残高																		137,372	136,849	140,393	137,351	140,485
うち無担																		114,789	114,979	116,840	114,454	117,489
うちO/N																		53,550	52,020	52,061	50,115	52,215
うち有担																		22,583	21,870	23,553	22,897	22,996

●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)
国庫短期証券	1411	-	30,000	2026/10/13	2027/4/12	93,605	23,214.5	99.306	1.4092%	56.8493%	99.308	1.4051%	6,785	
30年利付国債	92	4.2%	6,000	2026/10/9	2056/9/20	17,472	4,507	101.05	4.121%	40.5023%	101.21	4.109%	1,489	

●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)		2026/10/8	2026/10/9		0.800	256	256		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/8	2026/10/9		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、上展期間利回り、国債買現先の場合は、下展期間利回り、国債買入の場合は、下展利回較差。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9日の予定

*国庫短期証券(1412回)入札 (3ヶ月、33,000億円、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