

Central Daily Market Report

2026年10月9日(金)
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2026年10月9日 需給速報		2026年10月13日 需給予想		2026年10月14日 当社予想	
銀行券	▲ 100		0		400	
財政	▲ 5,300		14,700		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 5,400		14,700		▲ 1,600	
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						▲ 8,000
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		▲ 200		▲ 200		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 5,500		14,600		▲ 9,600	
当座預金残高	4,082,100		4,096,700		4,087,100	
準備預金残高	3,769,500					
積み終了先	3,769,500				10月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,769,400				積数	
非準備預金先	312,600				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	90.00%		

●2026年10月9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、週末4日積みとなったが相場に大きな変化はなく、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>

9日はTDB3M物(第1412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、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

10/9	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	1.190	1.250	1.227	1W	1.226	1.310	1.239		T+0	1.250	3.010	▲ 0.070	69,030.92	▲ 11.19	158.04-05	158.33-34	
T/N				2W			1.231		T+1	1.251							
S/N				3W													
2日				1M			1.350		1W	1.250							
3日				2M					2W	1.250							
4日				3M			1.500		3W	1.250							
5日				4M				1M	1.256								
6日				5M				3M	1.260								
有担保コール(速報)				6M				6M	1.385	6M	1.442						
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.600	1Y	1.645						

日付		10/2	10/5	10/6	10/7	10/8
日銀当預残		4,095,200	4,108,600	4,108,400	4,084,800	4,087,600
準備預金残		3,776,400	3,778,500	3,777,500	3,757,300	3,759,200
マネタリーベース		5,282,800	5,295,300	5,294,500	5,270,700	5,273,600
無担O/N加重平均		1.227%	1.227%	1.227%	1.227%	1.228%
コール市場残高		136,849	140,393	137,351	140,485	140,450
うち無担	うちO/N	114,979	116,840	114,454	117,489	117,117
	うち有担	21,870	23,553	22,897	22,996	23,333

●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	1412	-	33,000	2026/10/13	2027/1/18	115,754	25,296.6	99.6610	1.2799%	23.4077%	99.6626	1.2738%	7,703	

●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)		2026/10/9	2026/10/13		0.800	82	82		0.800	0.800	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/10/9	2026/10/13		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12日の予定

*スポーツの日

●2026年10月13日の予定

*9月の貸出・預金動向(日銀 8:50)
*9月の企業物価指数(日銀 8:50)
*9月のフェイルの発生状況(日銀 16:30)

◆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