

●資金需給

単位：億円	2026年8月6日 需給速報		2026年8月7日 需給予想		2026年8月10日 当社予想							
銀行券	▲ 600		▲ 100		600							
財政	23,500		4,800		9,000							
資金過不足	22,900		4,700		9,600							
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												
国債買現												
国債売現												
国庫短期証買入												
国債買入	5,200											
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	▲ 700	600		700								
※ドル資金供給用担保国債供給												
当預増減	28,000		5,400		9,600							
当座預金残高	4,183,000		4,188,400		4,198,000							
準備預金残高	3,856,100		<table><tr><td colspan="2">8月7日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>100</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				8月7日以降の残り所要積立額		積数	100	1日平均	0
8月7日以降の残り所要積立額												
積数	100											
1日平均	0											
積み終了先	3,856,100											
超過準備	3,856,100											
非準備預金先	326,900											
積み期間（7/16～8/15日）の所要準備額（積数）					4,195,400							
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	70.97%								

●2026年8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0.975~0.978%程度で推移した。ターム物では、主にショートタームでの引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、1.005%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日はTDB6M物(第1398回)の入札が実施され、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。
この他3M物と1Y物でも出合いが見られた。

＜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、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

8/6	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	0.950	1.030	0.980	1W	0.983	1.060	0.996			T+0	1.000	2.760	▲ 0.045	65,683.26	▲ 617.18	157.61-63	157.86-87
T/N				2W			1.115			T+1	1.000						
S/N			0.975	3W													
2日				1M	1.060	1.260	1.120			1W	1.000						
3日				2M						2W	1.000						
4日				3M			1.250			3W	1.000						
5日				4M						1M	1.002						
6日			1.100	5M				3M	1.055	3M	1.073						
有担保コール(速報)				6M				6M	1.175	6M	1.139						
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.280	1Y	1.260						
JGB新発10年債(%)																	
日付		7/30		7/31		8/3		8/4		8/5							
日銀当預残		4,392,200		4,380,700		4,300,200		4,188,500		4,155,000							
準備預金残		4,048,700		4,028,100		3,953,200		3,857,800		3,819,500							
マネタリーベース		5,588,100		5,576,200		5,495,500		5,383,600		5,350,400							
無担O/N加重平均		0.979%		0.977%		0.977%		0.978%		0.978%							
コール市場残高		121,427		122,151		128,968		123,243		124,706							
うち無担		99,511		98,900		105,353		99,715		101,862							
うちO/N		34,797		34,013		42,209		35,541		37,338							
うち有担		21,916		23,251		23,615		23,528		22,844							

●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	1398	-	35,000	2026/8/10	2027/2/10	98,264	26,844.6	99.407	1.1833%	65.9304%	99.411	1.1753%	8,155	
30年利付国債	91	4.0%	6,000	2026/8/7	2056/6/20	17,611	4,558	100.65	3.952%	48.9473%	100.86	3.937%	1,434	

●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)		2026/8/6	2026/8/7		0.500	746	746		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/6	2026/8/7		0.500	93	93		0.500	0.500	

●2026年8月7日の予定

*7月のオペレーション *7月の日本銀行の対政府取引 *7月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *消費活動指数 *7月のコール市場残高	*7月の米雇用統計	*国庫短期証券(1399回)入札 (3ヶ月、37,000億円、8/10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。
◆本資料は何ら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録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