

●資金需給

単位：億円	2026年8月7日 需給速報		2026年8月10日 需給予想		2026年8月12日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 600		400	
財政	5,500		3,100		▲ 2,000	
資金過不足	5,300		2,500		▲ 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						
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	▲ 500	700		500		
※下ろし資金供給用国債国債供給						
当預増減	5,500		3,000		▲ 1,600	
当座預金残高	4,188,500		4,191,500		4,189,900	
準備預金残高	3,855,200					
積み終了先	3,855,200				8月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,855,200				積数	
非準備預金先	333,300				1日平均	
積み期間（7/16～8/15日）の所要準備額（積数）					4,190,300	
準備預金進捗率	実績		100.00%		日数	
					80.65%	

●2026年8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、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＞
7日はTDB3M物(第1399回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。
この他1Y物でも出合いが見られた。

＜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

8/7	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	0.950	0.979	0.977	1W			0.982		T+0	1.000	2.795	+0.035	65,606.71	▲ 76.55		158.43-45	158.40-42
T/N				2W	1.033	1.150	1.064		T+1	1.000							
S/N			0.975	3W	1.065	1.090	1.078										
2日				1M	1.050	1.090	1.077		1W	1.000							
3日				2M					2W	1.000							
4日				3M			1.260		3W	1.000							
5日				4M					1M	1.001							
6日				5M					3M	1.081							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.175	6M	1.154						
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.300	1Y	1.264						
日付																	
日銀当預残		4,380,700		4,300,200		4,188,500		4,155,000		4,183,000							
準備預金残		4,028,100		3,953,200		3,857,800		3,819,500		3,856,800							
マネタリーベース		5,576,200		5,495,500		5,383,600		5,350,400		5,379,000							
無担O/N加重平均		0.977%		0.977%		0.978%		0.978%		0.980%							
コール市場残高		122,151		128,968		123,243		124,706		125,692							
うち無担		98,900		105,353		99,715		101,862		102,820							
うちO/N		34,013		42,209		35,541		37,338		38,186							
うち有担		23,251		23,615		23,528		22,844		22,872							

●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	1399	-	37,000	2026/8/10	2026/11/9	105,728	28,537.4	99.7330	1.0738%	0.8749%	99.7348	1.0665%	8,462	

●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)		2026/8/7	2026/8/10		0.500	561	561		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/7	2026/8/10		0.500	2	2		0.500	0.500	

●2026年8月10日の予定

*金融政策決定会合における主な意見(7月30・31日分)
*3月の貸出先別貸出金
*7月の貸出・預金動向
*6月の国際収支

◆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