

●資金需給

単位：億円	2026年8月12日 需給速報		2026年8月13日 需給予想		2026年8月14日 当社予想							
銀行券	0		▲ 100		▲ 600							
財政	▲ 16,900		▲ 3,200		78,500							
資金過不足	▲ 16,900		▲ 3,300		77,900							
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	▲ 100	300		100								
※下ろし資金供給用担保提供供給												
当預増減	▲ 16,700		▲ 3,200		77,900							
当座預金残高	4,174,700		4,171,500		4,249,400							
準備預金残高	3,849,200		<table><tr><td>8月13日以降の残り所要積立額</td><td></td></tr><tr><td>積数</td><td>0</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				8月13日以降の残り所要積立額		積数	0	1日平均	0
8月13日以降の残り所要積立額												
積数	0											
1日平均	0											
積み終了先	3,849,200											
超過準備	3,849,200											
非準備預金先	325,500											
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	90.32%								

●2026年8月12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、0.977~0.978%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、1.005%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＞
12日のアウトライト市場は、3M物、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

8/12	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	0.977	1W	0.983	0.985	0.984		T+0	1.000	2.850	+0.045	67,524.06	+553.84	159.26~28	159.37~38	
T/N				2W			1.055		T+1	1.000							
S/N			0.975	3W													
2日				1M			1.090		1W	1.000							
3日				2M					2W	1.000							
4日				3M			1.280		3W	1.000							
5日				4M				1M	1.003								
6日			1.100	5M				3M	1.080	3M	1.108						
有担保コール(速報)				6M				6M	1.200	6M	1.183						
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.320	1Y	1.274						
											日付		8/4	8/5	8/6	8/7	8/10
日銀当預残											4,188,500		4,155,000	4,183,000	4,188,500	4,191,400	
準備預金残											3,857,800		3,819,500	3,856,800	3,855,200	3,860,200	
マネタリーベース											5,383,600		5,350,400	5,379,000	5,384,700	5,388,300	
無担O/N加重平均											0.978%		0.978%	0.980%	0.977%	0.977%	
コール市場残高											123,243		124,706	125,692	130,328	128,791	
うち無担											99,715		101,862	102,820	107,167	105,044	
うちO/N											35,541		37,338	38,186	42,643	39,880	
うち有担											23,528		22,844	22,872	23,161	23,747	

●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)
物価連動10年	31	0.6%	2,500	2026/8/13	2036/3/10	8,167	2,499	97.70	0.860%	21.4285%				

●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
米ドル資金供給		2026/8/14	2026/8/20	3.880		1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/8/12	2026/8/13		0.500	82	82		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/12	2026/8/13		0.500	0	0				

●2026年8月13日の予定

*7月の企業物価指数	*4-6月期の英GDP速報値	*国有林野特会借入
*営業毎旬報告	*7月の米卸売物価指数(PPI)	(949億円、8/25発行)
*7月のフェイルの発生状況		
*日本銀行が保有する国債の銘柄別残高		

◆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