

●資金需給

単位：億円	2026年8月20日 需給速報		2026年8月21日 需給予想		2026年8月24日 当社予想							
銀行券	0		200		600							
財政	18,900		▲ 9,300		6,000							
資金過不足	18,900		▲ 9,100		6,600							
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	7,200											
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	400		700								
※下ろし資金供給用国債提供額												
当預増減	25,800		▲ 8,400		6,600							
当座預金残高	4,247,400		4,239,000		4,245,600							
準備預金残高	3,920,500		<table><tr><td colspan="2">8月21日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>41,400</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>1,600</td></tr></table>				8月21日以降の残り所要積立額		積数	41,400	1日平均	1,600
8月21日以降の残り所要積立額												
積数	41,400											
1日平均	1,600											
積み終了先	3,900,600											
超過準備	3,894,000											
非準備預金先	326,900											
積み期間（8/16～9/15日）の所要準備額(積数)					4,169,900							
準備預金進捗率	実績	99.01%	日数	12.20%								

●2026年8月20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、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＞
20日のアウトライト市場は、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あった。

●短期金融市場関連指標

8/20	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	1.025	0.977	1W	1.018	1.050	1.031		T+0	1.000	2.845	▲ 0.045	66,216.79	+890.37	158.25-27	158.44-45		
T/N				2W	1.030	1.080	1.053		T+1	1.000								
S/N				3W														
2日				1M			1.060		1W	1.000								
3日				2M					2W	1.000								
4日				3M			1.270		3W	1.000								
5日				4M				1M	1.001									
6日				5M				3M	1.020	3M	1.148							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.180	6M	1.216							
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.435	1Y	1.377							
												日付		8/13	8/14	8/17	8/18	8/19
												日銀当預残		4,170,800	4,256,100	4,250,000	4,244,400	4,221,600
												準備預金残		3,849,100	3,928,000	3,921,400	3,914,100	3,894,000
												マネタリーベース		5,367,800	5,452,900	5,446,100	5,440,300	5,417,400
												無担O/N加重平均		0.977%	0.977%	0.977%	0.977%	0.977%
												コール市場残高		121,809	121,223	120,903	120,991	122,492
												うち無担		98,774	98,368	98,134	98,173	99,043
												うちO/N		34,030	34,924	34,140	33,939	34,269
												うち有担		23,035	22,855	22,769	22,818	23,449

●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)
20年利付国債	197	3.7%	7,000	2026/8/21	2046/6/20	21,190	5,321	99.85	3.713%	83.5648%	100.02	3.698%	1,674	
交付税特会	-	-	12,000	2026/8/31	2027/2/26	50,514	11,999.99		1.320%	78.2879%		1.297%		-

●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)		2026/8/20	2026/8/21		0.500	824	824		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/20	2026/8/21		0.500	0	0				

●2026年8月21日の予定

*7月の全国消費者物価指数(CPI) *実質輸出入の動向	*8月の米PMI速報値	*国庫短期証券(1402回)入札 (3ヵ月、37,000億円、8/24発行)
---------------------------------	-------------	---

◆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