

●資金需給

単位：億円	2026年8月21日 需給速報		2026年8月24日 需給予想		2026年8月25日 当社予想	
銀行券	200		200		300	
財政	▲ 8,600		11,300		▲ 3,300	
資金過不足	▲ 8,400		11,500		▲ 3,000	
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	▲ 600	700		600		
※下ろし資金供給用国債償還供給						
当預増減	▲ 8,300		12,100		▲ 3,000	
当座預金残高	4,239,100		4,251,200		4,248,200	
準備預金残高	3,921,700					
積み終了先	3,919,500				8月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,909,600				積数 5,000	
非準備預金先	317,400				1日平均 200	
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 99.88%		日数		19.51%	

●2026年8月21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＞
21日に実施された3M物入札は強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーは堅調に推移した。その他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

8/21	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	0.980	0.976	1W	0.983	1.100	0.991		T+0	1.000	2.875	+0.030	66,016.36	▲ 200.43	158.87-89	158.82-84	
T/N				2W			1.150		T+1	1.000							
S/N				3W													
2日				1M			1.100		1W	1.000							
3日				2M					2W	1.000							
4日				3M			1.300		3W	1.000							
5日				4M				1M	1.002								
6日				5M				3M	1.079	3M	1.150						
有担保コール(速報)				6M				6M	1.180	6M	1.222						
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.430	1Y	1.401						

日付		8/14	8/17	8/18	8/19	8/20
日銀当預残		4,256,100	4,250,000	4,244,400	4,221,600	4,247,400
準備預金残		3,928,000	3,921,400	3,914,100	3,894,000	3,920,500
マネタリーベース		5,452,900	5,446,100	5,440,300	5,417,400	5,443,300
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		121,223	120,903	120,991	122,492	125,369
うち	無担	98,368	98,134	98,173	99,043	101,156
	うちO/N	34,924	34,140	33,939	34,269	36,222
	有担	22,855	22,769	22,818	23,449	24,213

●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	1402	-	37,000	2026/8/24	2026/11/24	108,891	28,137.8	99.7260	1.0900%	32.9474%	99.7281	1.0816%	8,862	

●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	応募総額(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)		2026/8/21	2026/8/24		0.500	639	639		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/21	2026/8/24		0.500	20	20		0.500	0.500	

●2026年8月24日の予定

*7月のFSBレポ統計の日本分集計結果 *営業毎旬報告 *日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	*8月の独IFO企業景況感指数	*GX10年利付国債入札(2,500億円、8/25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