

●資金需給

単位：億円	2026年8月26日 需給速報	2026年8月27日 需給予想	2026年8月28日 当社予想
銀行券	▲ 100	0	▲ 700
財政	▲ 9,700	▲ 7,200	▲ 1,000
資金過不足	▲ 9,800	▲ 7,200	▲ 1,700
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		200	
※下り資金供給用国債補完供給			
当預増減	▲ 9,600	▲ 7,200	▲ 1,700
当座預金残高	4,238,900	4,231,700	4,230,000
準備預金残高	3,918,700		
積み終了先	3,918,600	8月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,918,600	積数	1,100
非準備預金先	320,200	1日平均	100
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	99.97%	日数
			26.83%

●2026年8月26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＞
26日のアウトライト市場は、3M物と1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、大型発行を含め複数の業態で発行が観測された。
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

8/26	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	0.978	1W	0.982	1.110	1.010		T+0	0.999	2.885	▲ 0.005	66,262.16	+405.73	159.21-23	159.00-02					
T/N				2W			T+1		1.000												
S/N			0.970	3W																	
2日				1M	1.095	1.100	1.098		1W	1.000											
3日				2M					2W	1.000											
4日				3M					3W	1.000											
5日				4M					1M	1.023											
6日				5M					3M	1.055											
有担保コール（速報）				6M				6M	1.180	3M	1.167										
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.445	6M	1.247										
日付																					
8/19																					
8/20																					
8/21																					
8/24																					
8/25																					
日銀当預残										4,221,600		4,247,400		4,239,100		4,251,300		4,248,500			
準備預金残										3,894,000		3,920,500		3,921,700		3,928,500		3,922,400			
マネタリーベース										5,417,400		5,443,300		5,434,800		5,446,800		5,443,700			
無担O/N加重平均										0.977%		0.977%		0.976%		0.977%		0.977%			
コール市場残高										122,492		125,369		124,799		124,588		122,926			
										うち無担		99,043		101,156		101,725		101,107		100,591	
										うちO/N		34,269		36,222		36,651		36,303		35,502	
										うち有担		23,449		24,213		23,074		23,481		22,335	

●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)
流動性供給	460	-	6,500	2026/8/27	-	20,773	6,494		▲0.011%	58.2741%		▲0.014%		

●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)		2026/8/26	2026/8/27		0.500	9	9		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/26	2026/8/27		0.500	0	0				

●2026年8月27日の予定

*水見野副総裁講演 (埼玉県金融経済懇談会における挨拶)	*8月の米カンザスシティ連邦銀製造業景況指数 *ジャクソンホール会議(～29日)
---------------------------------	---

◆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