Central Daily Market Report

2026年8月27日（木）
セントラル短資株式会社　総合企画部

●資金需給

単位：億円	2026年8月27日 需給速報		2026年8月28日 需給予想		2026年8月31日 当社予想	
銀行券	0		200		▲ 500	
財政	▲ 5,500		5,400		8,000	
資金過不足	▲ 5,500		5,600		7,500	
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			4,100			
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 5,700		9,800		7,500	

当座預金残高	4,233,200	4,243,000	4,250,500
準備預金残高	3,918,300		
積み終了先	3,918,200	8月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,918,200	積数	1,000
非準備預金先	314,900	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 99.98%	日数	38.71%

●2026年8月27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>
27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発行市場は月末発行にあたり、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

8/27	無担保コール（速報）				短国		東京レポレート	
単位：%	最低	最高	平均		最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	
O/N	0.950	1.030	0.977	1W			0.981		T+0	1.000
T/N				2W					T+1	1.000
S/N				3W	1.045	1.150	1.077			
2日			1.025	1M			1.400		1W	1.000
3日				2M					2W	1.000
4日				3M			1.330		3W	1.000
5日				4M					1M	1.032
6日				5M				3M 1.055	3M	1.173
有担保コール（速報）				6M				6M 1.180	6M	1.253
翌日物			0.930	1Y				1Y 1.440	1Y	1.436

JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替（ドル/円）	
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
2.890	+0.005	66,131.98	▲ 130.18	159.24-26	159.35-36

日付	8/20	8/21	8/24	8/25	8/26
日銀当預残	4,247,400	4,239,100	4,251,300	4,248,500	4,238,900
準備預金残	3,920,500	3,921,700	3,928,500	3,922,400	3,918,700
マネタリーベース	5,443,300	5,434,800	5,446,800	5,443,700	5,434,200
無担O/N加重平均	0.977%	0.976%	0.977%	0.977%	0.978%
コール市場残高	125,369	124,799	124,588	122,926	121,693
うち無担	101,156	101,725	101,107	100,591	99,713
うちO/N	36,222	36,651	36,303	35,502	35,284
うち有担	24,213	23,074	23,481	22,335	21,980

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)	第Ⅰ非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。														

●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
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,200	2026/8/28				7,302	3,207	0.005		0.010	34.4
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,000	2026/8/28				2,823	1,007	0.007		0.009	84.9
国債買入（物価連動債）	300	2026/8/28				1,114	300		▲0.360	▲0.394	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/8/27	2026/8/28		0.500	207	207		0.500	0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/8/27	2026/8/28		0.500	0	0				

●2026年8月28日の予定

*8月の都区部消費者物価指数(CPI 総務省 8:30)
*7月の労働力調査(完全失業率 総務省 8:30)
*7月の有効求人倍率(厚生労働省 8:30)
*8月の米シカゴPMI
*国庫短期証券(1403回)入札
（3ヶ月、37,000億円、8/31発行）
*2年利付国債入札
（28,000億円、9/1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