

Central Daily Market Report

2026年8月28日(金)
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28日 需給速報		2026年8月31日 需給予想		2026年9月1日 当社予想	
銀行券	300		700		300	
財政	6,500		4,500		▲ 42,000	
資金過不足	6,800		5,200		▲ 41,700	
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		▲ 600		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 500	200		500		
※下ろし資金供給用担保国債供給						
当預増減	10,500		5,100		▲ 41,700	
当座預金残高	4,243,700		4,248,800		4,207,100	
準備預金残高	3,920,100					
積み終了先	3,920,000				8月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,920,000				積数 700	
非準備預金先	323,600				1日平均 0	
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 36.59%			

●2026年8月28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。週末3日積みとなったが特段の変化は見られなかった。
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、1.00%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>

28日はTDB3M物(第1403回)の入札が実施され、無難な結果となり、結果発表後のセカンダリーでは堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、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

8/28	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	0.979	0.977	1W	0.982	0.983	0.983			T+0	1.000	2.926	+0.036	66,405.56	+273.58	159.30~32	159.50~51
T/N				2W						T+1	1.000						
S/N				3W	1.040	1.100	1.063										
2日				1M			1.150			1W	1.000						
3日				2M						2W	1.000						
4日			1.100	3M			1.410			3W	1.000						
5日				4M				3M	1.060	1M	1.044						
6日				5M				6M	1.185	3M	1.180						
有担保コール(速報)				6M				1Y	1.445	6M	1.256						
翌日物			0.930	1Y			1.620			1Y	1.442						
日付																	
日銀当預残				8/21	8/24	8/25	8/26	8/27									
準備預金残				4,239,100	4,251,300	4,248,500	4,238,900	4,233,200									
マネタリーベース				3,921,700	3,928,500	3,922,400	3,918,700	3,918,300									
無担O/N加重平均				5,434,800	5,446,800	5,443,700	5,434,200	5,428,600									
コール市場残高				0.976%	0.977%	0.977%	0.978%	0.977%									
うち無担				124,799	124,588	122,926	121,693	124,038									
うちO/N				101,725	101,107	100,591	99,713	102,250									
うち有担				36,651	36,303	35,502	35,284	36,441									
				23,074	23,481	22,335	21,980	21,788									

●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	1403	-	37,000	2026/8/31	2026/11/30	91,171	28,381.7	99.7300	1.0858%	79.6572%	99.7316	1.0794%	8,618	
2年利付国債	488	1.7%	28,000	2026/9/1	2028/9/1	63,637	21,454	99.950	1.725%	93.3094%	99.984	1.708%	6,540	1.65

●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)		2026/8/28	2026/8/31		0.500	495	495		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/28	2026/8/31		0.500	0	0				

●2026年8月31日の予定

*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(経済産業省 8:50) *London祝日(Summer Bank Holiday)
*7月の自動車生産・輸出実績(各社 13:00頃)
*7月の貸出約定平均金利(日銀 8:50)
*7月の決済動向(日銀 11:00)

◆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