

●資金需給

単位：億円	2026年8月31日 需給速報	2026年9月1日 需給予想	2026年9月2日 当社予想
銀行券	700	500	300
財政	▲ 100	▲ 49,200	▲ 40,000
資金過不足	600	▲ 48,700	▲ 39,700
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 8,000
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	▲ 600	▲ 200	
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 400	500	400
※下ろし資金供給用担保国債供給			
当預増減	100	▲ 48,500	▲ 47,700
当座預金残高	4,243,800	4,195,300	4,147,600
準備預金残高	3,905,400		
積み終了先	3,905,300	9月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,905,300	積数	600
非準備預金先	338,400	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	99.99%	日数
			51.61%

●2026年8月31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が必要が見られたことで、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＞
31日のアウトライト市場は、3M物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は複数の発行が観測され、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

8/31	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	0.977	1W			0.983			T+0	1.000	2.940	+0.014	66311.93	▲ 93.63	160.11-12	159.56-58	
T/N				2W		1.060	T+1			1.000								
S/N				3W														
2日				1M		1.180												
3日				2M														
4日				3M														
5日				4M							日付		8/24	8/25	8/26	8/27	8/28	
6日				5M							日銀当預残		4,251,300	4,248,500	4,238,900	4,233,200	4,243,700	
有担保コール(速報)				6M							準備預金残		3,928,500	3,922,400	3,918,700	3,918,300	3,920,100	
翌日物			0.930	1Y							マネタリーベース		5,446,800	5,443,700	5,434,200	5,428,600	5,438,800	
							3M		1.010	3M	1.050	無担O/N加重平均		0.977%	0.977%	0.978%	0.977%	0.977%
							6M		1.185	6M	1.260	コール市場残高		124,588	122,926	121,693	124,038	124,780
							1Y		1.445	1Y	1.449	うち無担		101,107	100,591	99,713	102,250	102,596
												うちO/N		36,303	35,502	35,284	36,441	37,503
												うち有担		23,481	22,335	21,980	21,788	22,184

●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)	第1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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/8/31	2026/9/1		0.500	464	464		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/8/31	2026/9/1		0.500	0	0				

※1. オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)、米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り、国債買現先の場合は、下限期間利回り、国債買入の場合は、下限利回較差。国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。

●2026年9月1日の予定

*7月の労働力調査(完全失業率 総務省 8:30)	*8月のユーロ圏消費者物価指数速報値	*10年利付国債入札(26,000億円、9/2発行)
*8月の日銀当座預金増減要因と金融調節(日銀 13:00)	*8月の米製造業PMI改定値	
*8月の債券市場サーベイ(日銀 16:00)	*8月のISM製造業景況指数	

◆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