

Central Daily Market Report

2026年2月26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2月26日 需給速報	2026年2月27日 需給予想	2026年3月2日 当社予想			
銀行券	▲ 300	300	700			
財政	▲ 4,400	5,500	▲ 24,000			
資金過不足	▲ 4,700	5,800	▲ 23,300			
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		6,100				
貸出支援基金(成)						▲ 7,900
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	▲ 800			
気候変動対応オペ						
国債補充供給	▲ 3,600	3,600	3,600			
※下月資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 4,800	14,700	▲ 31,200			
当座預金残高	4,601,100	4,615,800	4,584,600			
準備預金残高	4,250,000					
積み終了先	4,249,200			2月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,249,200			積数	6,000	
非準備預金先	351,100			1日平均	400	
積み期間(2/16~3/15日)の所要準備額(積数)					3,731,900	
準備預金進捗率	実績	99.84%	日数	39.29%		

●2026年2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、出合いの水準は0.727~0.728%程度で推移した。また、試し取りにより付利金利を上回る水準での出合いも一部見られた。ターム物は、ショートタームを中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.75%前後の出合いとなった。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日のアウトライイト市場は、3M物、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、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2/26	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買取統計値	平均値		
O/N	0.700	0.780	0.728	1W	0.780	0.860	0.796	T+0	0.748	
T/N				2W	0.731	0.900	0.776	T+1	0.747	
S/N				3W	0.810	0.950	0.866			
2日				1M	0.820	0.850	0.828	1W	0.747	
3日				2M				2W	0.747	
4日				3M	1.040	1.100	1.070	3W	0.747	
5日				4M				1M	0.748	
6日				5M				3M	0.803	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.874	
O/N			0.680	1Y				1Y	0.989	

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	
2.150	+0.015	58,753.39	+170.27	156.16-19	156.03-04	
日付		2/18	2/19	2/20	2/24	2/25
日銀当預残	4,586,400	4,598,600	4,602,100	4,596,700	4,605,900	
準備預金残	4,235,200	4,243,500	4,248,900	4,251,200	4,260,200	
マネタリーベース	5,801,300	5,813,800	5,818,000	5,812,900	5,821,500	
無担O/N加重平均	0.728%	0.728%	0.729%	0.727%	0.729%	
コール市場残高	129,514	129,290	133,900	128,986	129,152	
うち無担	104,277	103,775	107,132	102,614	103,528	
うちO/N	41,799	41,297	45,934	41,366	42,830	
うち有担	25,237	25,515	26,768	26,372	25,624	

●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)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	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	応募総額(億円・百万ドル)	発札総額(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	平均発札レート・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)	2,450	2026/2/27				6,831	2,453	0.034		0.036	86.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	2,600	2026/2/27				8,082	2,601	0.029		0.029	90.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	950	2026/2/27				3,100	952	0.027		0.031	37.0
国債買入(物価連動債)	400	2026/2/27				1,494	401	▲0.370		▲0.377	77.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/2/26	2026/2/27		0.550	3,860	3,860		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/2/26	2026/2/27		0.550	20	20		0.550	0.550	

●2026年2月27日の予定

*2月の都区部消費者物価指数	*1月の米生産者物価指数	*国庫短期証券(第1365回)入札(3か月、47,000億円、3/2発行)
*1月の商業動態統計速報	*2月のシカゴPM景況感指数	*2年利付国債入札(28,000億円、3/2発行)
*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*11・12月の米建設支出	
*1月の住宅着工件数		

◆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よう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りする書面や目録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