

Central Daily Market Report

2026年2月27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2月27日 需給速報	2026年3月2日 需給予想	2026年3月3日 当社予想			
銀行券	300	100	400			
財政	4,600	▲ 39,700	▲ 10,000			
資金過不足	4,900	▲ 39,600	▲ 9,600			
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		▲ 800				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 3,600	3,600		3,600		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	10,200	▲ 43,900		▲ 9,600		
当座預金残高	4,611,300	4,567,400		4,557,800		
準備預金残高	4,247,100					
積み終了先	4,246,300		3月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,246,300		積数	3,600		
非準備預金先	364,200		1日平均	300		
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	99.90%	日数	50.00%		

●2026年2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、月末要因から取引を控える先が一部見られたものの、週末3日積みとなった事からレート水準に大きな変化はなく、引き続き0.727~0.728%程度での出会いが中心となった。

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%前後の出会いとなった。

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日はTDB3M物(第1365回)の入札が実施され、落ち着いた結果となった。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、数件の入札が実施された。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

2/27	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	売買参考統計値	平均値		
O/N	0.700	0.728	0.727	1W	0.727	0.860	0.757	T+0	0.748	
T/N				2W				T+1	0.750	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.747	
3日				2M				2W	0.747	
4日			0.850	3M	1.020	1.070	1.035	3W	0.747	
5日				4M				1M	0.748	
6日				5M				3M	0.805	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.878	
O/N			0.680	1Y				1Y	0.990	

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	9時	17時
2.110	▲ 0.040	58,850.27	+96.88	155.85-88	156.08-10		
日付		2/19	2/20	2/24	2/25	2/26	
日銀当預残	4,598,600	4,602,100	4,596,700	4,605,900	4,601,100		
準備預金残	4,243,500	4,248,900	4,251,200	4,260,200	4,247,500		
マネタリーベース	5,813,800	5,818,000	5,812,900	5,821,500	5,817,000		
無担O/N加重平均	0.728%	0.729%	0.727%	0.729%	0.728%		
コール市場残高	129,290	133,900	128,986	129,152	127,853		
うち無担	103,775	107,132	102,614	103,528	102,452		
うちO/N	41,297	45,934	41,366	42,830	42,504		
うち有担	25,515	26,768	26,372	25,624	25,401		

●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・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	1365	-	47,000	2026/3/2	2026/6/1	106,841	36,697.5	99.8050	0.7836%	4.5253%	99.8080	0.7715%	10,302	
2年利付国債	482	1.3%	28,000	2026/3/2	2028/3/1	71,214	21,456	100.095	1.251%	41.7753%	100.108	1.244%	6,537	0.43

●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)	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/2/27	2026/3/2		0.450	3,877	3,877		0.450	0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/2/27	2026/3/2		0.450	0	0				

●2026年3月2日の予定

*水見野日銀副総裁 和歌山県金融経済懇談会における挨拶	*2月のISM製造業景況指数
-----------------------------	----------------

◆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