

Central Daily Market Report

2026年3月3日(火)

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3月3日 需給速報	2026年3月4日 需給予想	2026年3月5日 当社予想			
銀行券	300	▲ 100	0			
財政	▲ 22,300	▲ 69,700	▲ 1,500			
資金過不足	▲ 22,000	▲ 69,800	▲ 1,500			
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		8,000	▲ 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(成)						
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	▲ 3,200	3,200	3,200			
※米ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 22,000	▲ 66,700	▲ 1,500			
当座預金残高	4,543,500	4,476,800	4,475,300			
準備預金残高	4,189,900					
積み終了先	4,189,100			3月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,189,100			積数	1,800	
非準備預金先	353,600			1日平均	200	
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	99.95%	日数	57.14%		

●2026年3月3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、前日に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。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>

3日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、複数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

3/3	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)	
	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	0.700	0.775	0.727	1W	0.710	0.734	0.723	T+0	0.748	2.125	+0.065	56,279.05	▲ 1,778.19	157.26-29	157.41-43	
T/N				2W	0.715	0.780	0.733	T+1	0.750							
S/N				3W												
2日				1M				1W	0.747							
3日				2M				2W	0.747							
4日				3M			1.100	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	0.880							
O/N			0.680	1Y				1Y	0.990							

日付	2/24	2/25	2/26	2/27	3/2
日銀当預残	4,596,700	4,605,900	4,601,100	4,611,300	4,565,500
準備預金残	4,251,200	4,260,200	4,247,500	4,247,100	4,202,900
マネタリーベース	5,812,900	5,821,500	5,817,000	5,826,800	5,780,900
無担O/N加重平均	0.727%	0.729%	0.728%	0.727%	0.727%
コール市場残高	128,986	129,152	127,853	123,881	124,747
うち無担	102,614	103,528	102,452	99,583	99,455
うちO/N	41,366	42,830	42,504	41,115	41,237
うち有担	26,372	25,624	25,401	24,298	25,292

●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)
10年利付国債	381	2.1%	26,000	2026/3/4	2035/12/20	66,239	20,046	99.76	2.129%	70.0493%	99.82	2.122%	5,944	5.35
交付税特会	-	-	12,500	2026/3/12	2026/9/11	45,479	12,500		1.205%	86.0387%		1.191%		-

●オペ結果

種類	オフア一額(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
米ドル資金供給		2026/3/5	2026/3/12	3.890		1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア一分)		2026/3/3	2026/3/4		0.550	3,381	3,381		0.550	0.539	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2026/3/4	2026/3/18	0.750		16,494	8,003				48.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア一分)		2026/3/3	2026/3/4		0.550	83	83		0.550	0.550	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2026/3/4	2026/3/13		0.720	2	2		0.720	0.720	

●2026年3月4日の予定

*3月の日銀当座預金増減要因見込み	*米ページブック
*2月の消費動向調査	*2月のISM非製造業景況指数

◆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録書等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