

Central Daily Market Report

2026年3月5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3月5日 需給速報	2026年3月6日 需給予想	2026年3月9日 当社予想			
銀行券	200	200	1,000			
財政	7,400	▲ 1,000	▲ 4,000			
資金過不足	7,600	▲ 800	▲ 3,000			
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	6,700					
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	▲ 700			
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 3,500	3,600	3,500			
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	14,300	2,000	▲ 3,000			
当座預金残高	4,487,000	4,489,000	4,486,000			
準備預金残高	4,142,400					
積み終了先	4,142,000			3月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,142,000			積数	800	
非準備預金先	344,600			1日平均	100	
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	99.98%	日数	64.29%		

●2026年3月5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。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>

5日のアウトライト市場は、6M物と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

3/5	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	0.780	0.728	1W	0.720	0.726	0.724	T+0	0.749	
T/N				2W	0.728	0.860	0.746	T+1	0.750	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.747	
3日				2M				2W	0.747	
4日				3M				3W	0.747	
5日				4M				1M	0.748	
6日			0.850	5M			3M	0.760	3M	0.807
有担保コール(速報)				6M			6M	0.850	6M	0.880
O/N			0.680	1Y			1Y	1.015	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	
2.155	+0.045	55,278.06	+1,032.52	156.97-99	157.25-27	
日付		2/26	2/27	3/2	3/3	3/4
日銀当預残	4,601,100	4,611,300	4,565,500	4,543,500	4,472,700	
準備預金残	4,247,500	4,247,100	4,202,900	4,190,100	4,121,900	
マネタリーベース	5,817,000	5,826,800	5,780,900	5,758,600	5,687,900	
無担O/N加重平均	0.728%	0.727%	0.727%	0.727%	0.730%	
コール市場残高	127,853	123,881	124,747	125,667	127,948	
うち無担	102,452	99,583	99,455	100,519	102,177	
うちO/N	42,504	41,115	41,237	41,951	43,549	
うち有担	25,401	24,298	25,292	25,148	25,771	

●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非競争額(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	89	3.40%	7,000	2026/3/6	2055/12/20	19,377	5,300	99.90	3.406%	89.6341%	100.02	3.398%	1,693	

●オペ結果

種類	オフー額(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(午前オフー分)		2026/3/5	2026/3/6		0.550	3,800	3,800		0.550	0.548	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)		2026/3/5	2026/3/6		0.550	0	0				

●2026年3月6日の予定

*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*2月の米雇用統計 *1月の米消費者信用残高 *1月の米小売売上高 *12月の米企業在庫 *10-12月期のユーロ圏GDP確報値	*国庫短期証券(1366回)入札 (3か月、47,000億円、3/9発行)
----------------------	--	--

◆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