Central Daily Market Report

2026年3月11日（水）
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11日 需給速報	2026年3月12日 需給予想	2026年3月13日 当社予想
銀行券	500	200	▲ 500
財政	▲ 4,600	▲ 25,400	5,000
資金過不足	▲ 4,100	▲ 25,200	4,500

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,600					
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	▲ 6,300	6,400		6,300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	2,600		▲ 19,000		4,500	

当座預金残高	4,487,200	4,468,200	4,472,700
準備預金残高	4,127,100		
積み終了先	4,127,100		
超過準備	4,127,100		
非準備預金先	360,100		

3月12日以降の残り所要積立額	
積数	0
1日平均	0

積み期間（2/16～3/15日）の所要準備額（積数）	3,724,500
準備預金進捗率　実績	100.00%
日数	85.71%

●2026年3月11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。
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>
11日のアウトライト市場は、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>
CP発行市場は大型発行を含め、複数の業態で入札が実施された。
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

3/11	無担保コール（速報）							短国		東京レポレート	
単位：%	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	0.729	0.727	1W	0.720	0.745	0.726			T+0	0.750
T/N			0.775	2W						T+1	0.752
S/N				3W							
2日				1M						1W	0.748
3日				2M						2W	0.748
4日				3M			1.100			3W	0.748
5日				4M						1M	0.749
6日			0.850	5M				3M	0.740	3M	0.813
有担保コール（速報）				6M				6M	0.865	6M	0.879
O/N			0.680	1Y				1Y	0.990	1Y	0.992

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	▲ 0.025	55,025.37	+776.98	158.09-12	158.22-24

日付	3/4	3/5	3/6	3/9	3/10
日銀当預残	4,472,700	4,487,000	4,491,000	4,480,500	4,484,600
準備預金残	4,121,900	4,140,300	4,134,300	4,137,100	4,126,200
マネタリーベース	5,687,900	5,701,900	5,705,700	5,694,700	5,697,900
無担O/N加重平均	0.730%	0.728%	0.728%	0.727%	0.728%
コール市場残高	127,948	127,590	126,500	125,434	124,741
うち無担	102,177	101,168	99,822	99,278	98,216
うちO/N	43,549	41,910	41,094	39,650	38,123
うち有担	25,771	26,422	26,678	26,156	26,525

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	183	1.6%	25,000	2026/3/12	2030/12/20	70,880	19,216	99.84	1.636%	80.4120%	99.85	1.633%	5,768	11

●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）		2026/3/11	2026/3/12		0.550	6,642	6,642		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/3/11	2026/3/12		0.550	221	221		0.550	0.550	

●2026年3月12日の予定

*1-3月期の法人企業景気予測調査
*1月の米貿易収支
*1月の米新規住宅着工件数

◆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