

Central Daily Market Report

2026年3月12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12日 需給速報	2026年3月13日 需給予想	2026年3月16日 当社予想			
銀行券	300	100	1,000			
財政	▲ 27,300	▲ 200	▲ 8,000			
資金過不足	▲ 27,000	▲ 100	▲ 7,000			
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						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						▲ 57,570
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	▲ 600			
気候変動対応オペ						
国債補充供給	▲ 6,000	6,300	6,000			
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 26,800	5,300	▲ 64,570			
当座預金残高	4,460,400	4,465,700	4,401,130			
準備預金残高	4,094,800					
積み終了先	4,094,800			3月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,094,800			積数	0	
非準備預金先	365,600			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	89.29%		

●2026年3月12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>

12日のアウトライイト市場は、6M物、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

3/12	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	0.734	1W				T+0	0.751	
T/N				2W	0.728	0.860	0.750	T+1	0.753	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.749	
3日				2M				2W	0.749	
4日				3M				3W	0.749	
5日				4M				1M	0.749	
6日				5M				3M	0.814	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.879	
O/N			0.680	1Y				1Y	0.994	

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	
2.180	+0.025	54,452.96	▲ 572.41	159.07-09	158.78-81	
日付		3/5	3/6	3/9	3/10	3/11
日銀当預残	4,487,000	4,491,000	4,480,500	4,484,600	4,487,200	
準備預金残	4,140,300	4,134,300	4,137,100	4,126,200	4,127,100	
マネタリーベース	5,701,900	5,705,700	5,694,700	5,697,900	5,700,100	
無担O/N加重平均	0.728%	0.728%	0.727%	0.728%	0.727%	
コール市場残高	127,590	126,500	125,434	124,741	123,281	
うち無担	101,168	99,822	99,278	98,216	97,073	
うちO/N	41,910	41,094	39,650	38,123	36,595	
うち有担	26,422	26,678	26,156	26,525	26,208	

●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	オフター額(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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2026/3/12	2026/3/13		0.550	6,282	6,282		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2026/3/12	2026/3/13		0.550	292	292		0.550	0.550	

●2026年3月13日の予定

*10-12月期の米GDP改定値	*国庫短期証券(第1368回)入札(3か月、47,000億円、3/16発行)	*10年クワイメート・トランジション利付国債入札(3,000億円、3/16発行)
*1月の米個人消費・所得支出(PCE)		
*3月のミシガン大学消費者信頼感指数		
*1月の米耐久財受注		

◆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