Central Daily Market Report

2026年3月13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3月13日 需給速報	2026年3月16日 需給予想	2026年3月17日 当社予想
銀行券	200	800	300
財政	1,900	▲ 3,400	6,000
資金過不足	2,100	▲ 2,600	6,300

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）				▲ 50,000		
被災地支援						
社債等買入		▲ 600				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 5,600	6,000		5,600		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	1,900		▲ 47,000		6,300	

当座預金残高	4,462,300	4,415,300	4,421,600
準備預金残高	4,098,900		
積み終了先	4,098,900		
超過準備	4,098,900		
非準備預金先	363,400		

3月16日以降の残り所要積立額	
積数	4,128,900
1日平均	133,200

積み期間（3/16～4/15日）の所要準備額（積数）	4,128,900
準備預金進捗率　実績	0.00%　日数 0.00%

●2026年3月13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>
13日はTDB3M物(第1368回)の入札が実施され、無難な結果となった。
結果発表後のセカンダリーでは底堅く推移した。
このほか、6M物と1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>
CP発行市場は、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

3/13	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	0.750	0.728	1W			0.860			T+0	0.751
T/N				2W			0.780			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	0.780	3M	0.815
有担保コール（速報）				6M				6M	0.865	6M	0.880
O/N			0.680	1Y				1Y	1.015	1Y	0.995

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
2.240	+0.060	53,819.61	▲ 633.35	159.22-25	159.42-44

日付	3/6	3/9	3/10	3/11	3/12
日銀当預残	4,491,000	4,480,500	4,484,600	4,487,200	4,460,400
準備預金残	4,134,300	4,137,100	4,126,200	4,127,100	4,095,000
マネタリーベース	5,705,700	5,694,700	5,697,900	5,700,100	5,672,900
無担O/N加重平均	0.728%	0.727%	0.728%	0.727%	0.734%
コール市場残高	126,500	125,434	124,741	123,281	125,225
うち無担	99,822	99,278	98,216	97,073	98,609
うちO/N	41,094	39,650	38,123	36,595	39,161
うち有担	26,678	26,156	26,525	26,208	26,616

●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)
国庫短期証券	1368	－	47,000	2026/3/16	2026/6/15	102,485	36,030.7	99.8060	0.7796%	96.2179%	99.8074	0.7740%	10,969	
GX10年利付国債	4	2.1%	3,000	2026/3/16	2035/12/20	10,260	2,999	99.17	2.195%	21.3333%				

●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）		2026/3/13	2026/3/16		0.550	5,744	5,744		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/3/13	2026/3/16		0.550	380	380		0.550	0.550	

●2026年3月16日の予定

*2月の米鉱工業生産

◆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