

Central Daily Market Report

2026年3月24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24日 需給速報	2026年3月25日 需給予想	2026年3月26日 当社予想			
銀行券	700	400	▲ 500			
財政	▲ 1,500	19,400	9,000			
資金過不足	▲ 800	19,800	8,500			
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						
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	▲ 100			
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 5,500	6,700	5,500			
当増減	300	25,200	8,500			
当座預金残高	4,507,400	4,532,600	4,541,100			
準備預金残高	4,154,000					
積み終了先	4,149,600			3月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,149,000			積数	16,000	
非準備預金先	353,400			1日平均	700	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)					4,128,900	
準備預金進捗率	実績	99.61%	日数	29.03%		

●2026年3月24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、0.75~0.755%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>

24日のアウトライト市場は、3M物と6M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で発行が見られた。発行レートは横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

3/24	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	0.780	0.727	1W	0.900	1.250	1.075	T+0	0.749	
T/N				2W			1.050	T+1	0.750	
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			0.780	5M				3M	0.841	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.898	
O/N			0.680	1Y				1Y	1.014	

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	
2.265	▲ 0.040	52,252.28	+736.79	158.48-50	158.49-50	
日付		3/16	3/17	3/18	3/19	3/23
日銀当預残	4,404,400	4,419,400	4,408,500	4,431,800	4,507,100	
準備預金残	4,056,100	4,076,600	4,059,200	4,078,800	4,146,800	
マネタリーベース	5,615,900	5,631,100	5,620,400	5,644,000	5,719,100	
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.728%	0.727%	
コール市場残高	116,608	116,155	118,024	115,333	115,676	
うち無担	90,427	90,768	91,805	88,805	88,949	
うちO/N	33,749	35,090	35,067	35,227	35,721	
うち有担	26,181	25,387	26,219	26,528	26,727	

●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	棄分率	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)
40年利付国債	18	3.1%	4,000	2026/3/25	2065/3/20	10,157	3,998	89.57	3.600%	90.6542%				

●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
米ドル資金供給		2026/3/26	2026/4/2	3.890		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2026/3/24	2026/3/25		0.550	6,092	6,092		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2026/3/24	2026/3/25		0.550	0	0				

●2026年3月25日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(1月22,23日分)	*2月の英消費者物価指数
*1月の景気動向指数改訂状況	

◆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