

Central Daily Market Report

2026年3月26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26日 需給速報	2026年3月27日 需給予想	2026年3月30日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 100	1,000			
財政	10,100	▲ 1,100	13,000			
資金過不足	9,800	▲ 1,200	14,000			
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	6,100					
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補充供給	▲ 3,200	4,100		3,200		
当預増減	16,800	2,000				14,000
当座預金残高	4,554,100	4,556,100				4,570,100
準備預金残高	4,204,200					
積み終了先	4,202,900				3月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,200,800				積数	8,100
非準備預金先	349,900				1日平均	400
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	99.80%			日数	35.48%

●2026年3月26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、0.745~0.755%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>

26日のアウトライト市場は、3M物、6M物、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は多く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

3/26 単位: %	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	0.775	0.727	1W				T+0	0.747	
T/N				2W				T+1	0.745	
S/N				3W						
2日			0.950	1M	0.900	0.920	0.911	1W	0.741	
3日				2M				2W	0.745	
4日			0.850	3M				3W	0.745	
5日				4M				1M	0.745	
6日				5M				3M	0.846	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.890	
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.017	

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	
2.270	+0.020	53,603.65	▲ 145.97	159.39-40	159.49-50	
日付		3/18	3/19	3/23	3/24	3/25
日銀当預残	4,408,500	4,431,800	4,507,100	4,507,400	4,537,300	
準備預金残	4,059,200	4,078,800	4,146,800	4,150,000	4,183,900	
マネタリーベース	5,620,400	5,644,000	5,719,100	5,718,700	5,748,300	
無担O/N加重平均	0.727%	0.728%	0.727%	0.727%	0.727%	
コール市場残高	118,024	115,333	115,676	115,744	113,963	
うち無担	91,805	88,805	88,949	90,514	89,141	
うちO/N	35,067	35,227	35,721	36,286	34,549	
うち有担	26,219	26,528	26,727	25,230	24,822	

●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非償額額争入札(億円)	非償額額争入札(億円)
流動性供給	450	-	7,000	2026/3/27	-	27,292	6,972		0.014%	97.2575%		0.013%		

●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)		2026/3/26	2026/3/27		0.450	3,553	3,553		0.450	0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2026/3/26	2026/3/27		0.450	0	0				

●2026年3月27日の予定

*国庫短期証券(1371回)入札
(3か月、47,000億円、3/30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