

# Central Daily Market Report

2026年3月30日(月)  
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30日 需給速報	2026年3月31日 需給予想	2026年4月1日 当社予想			
銀行券	800	1,100	500			
財政	33,900	9,900	▲ 26,000			
資金過不足	34,700	11,000	▲ 25,500			
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						▲ 8,000
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						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 6,300	3,900	6,300			
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	32,300	17,300	▲ 33,500			
当座預金残高	4,585,700	4,603,000	4,569,500			
準備預金残高	4,223,700					
積み終了先	4,222,700			3月31日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,222,700			積数	3,600	
非準備預金先	362,000			1日平均	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	99.91%	日数	48.39%		

## ●2026年3月30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、先日付で4月スタートの引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.735~0.76%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>

30日のアウトライト市場は、3M物、6M物で出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●入札結果

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。

## ●短期金融市場関連指標

3/30	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	0.729	0.726	1W		0.732		T+0	0.748	
T/N			1.500	2W	0.790	0.900		T+1	0.746	
S/N				3W		0.825				
2日				1M		0.930		1W	0.744	
3日			1.000	2M				2W	0.747	
4日				3M				3W	0.747	
5日				4M				1M	0.747	
6日				5M			3M	0.840	3M	0.857
有担保コール(速報)				6M			6M	0.900	6M	0.908
翌日物			0.680	1Y			1Y	1.075	1Y	1.023

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	
2.355	▲ 0.015	51,885.85	▲ 1,487.22	160.22-24	159.77-78	
日付		3/23	3/24	3/25	3/26	3/27
日銀当預残	4,507,100	4,507,400	4,537,300	4,554,100	4,553,400	
準備預金残	4,146,800	4,150,000	4,183,900	4,204,200	4,163,800	
マネタリーベース	5,719,100	5,718,700	5,748,300	5,765,300	5,764,500	
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	
コール市場残高	115,676	115,744	113,963	113,317	113,581	
うち無担	88,949	90,514	89,141	88,665	88,587	
うちO/N	35,721	36,286	34,549	34,393	35,915	
うち有担	26,727	25,230	24,822	24,652	24,994	

## ●オペ結果

種類	オフア額 (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(午前オフア分)		2026/3/30	2026/3/31		0.550	6,723	6,723		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2026/3/30	2026/3/31		0.550	100	100		0.550	0.550	

## ●2026年3月31日の予定

*3月の都区部消費者物価指数	*3月の米CB消費者信頼感指数	*2年利付国債入札 (28,000億円、4/1発行)
*2月の労働力調査	*3月のシカゴPM景況感指数	
*2月の一般職業紹介状況	*S&Pケースシラー住宅価格指数	
*2月の商業動態統計速報	*3月のユーロ圏消費者物価指数速報値	
*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*10-12月期の英GDP確報値	
*2月の住宅着工統計		

◆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