

Central Daily Market Report

2026年4月1日(水)
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4月1日 需給速報	2026年4月2日 需給予想	2026年4月3日 当社予想			
銀行券	0	500	200			
財政	▲ 24,700	9,700	▲ 26,000			
資金過不足	▲ 24,700	10,200	▲ 25,800			
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	▲ 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						
国債補充供給	▲ 8,400	4,000	8,400			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 29,100	18,600	▲ 25,800			
当座預金残高	4,568,700	4,587,300	4,561,500			
準備預金残高	4,182,700					
積み終了先	4,181,400			4月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,181,300			積数	800	
非準備預金先	386,000			1日平均	100	
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	99.98%	日数	54.84%		

●2026年4月1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、決定会合を越えない期間での出合いが中心となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.755~0.76%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>

1日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、一部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。

●短期金融市場関連指標

4/1	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	売買取引統計値	平均値		
O/N	0.700	0.780	0.728	1W	0.734	0.830	0.779	T+0	0.748	
T/N				2W				0.840	T+1	0.752
S/N				3W	0.800	0.820	0.813			
2日				1M	0.815	0.840	0.823	1W	0.747	
3日				2M				2W	0.747	
4日				3M			1.100	3W	0.747	
5日				4M				1M	0.752	
6日				5M				3M	0.865	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.915	
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.039	

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	
2.300	▲ 0.055	53,739.68	+2,675.96	158.58-60	158.79-80	
日付		3/25	3/26	3/27	3/30	3/31
日銀当預残	4,537,300	4,554,100	4,553,400	4,585,700	4,597,800	
準備預金残	4,183,900	4,204,200	4,163,800	4,223,700	4,210,400	
マネタリーベース	5,748,300	5,765,300	5,764,500	5,796,100	5,807,000	
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.726%	0.727%	
コール市場残高	113,963	113,317	113,581	111,897	96,925	
うち無担	89,141	88,665	88,587	87,611	73,237	
うちO/N	34,549	34,393	35,915	36,289	29,045	
うち有担	24,822	24,652	24,994	24,286	23,688	

●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I非価格競争入札(億円)	第I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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/4/1	2026/4/2		0.550	9,101	9,101		0.550	0.548	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/4/1	2026/4/2		0.550	258	258		0.550	0.531	

●2026年4月2日の予定

*3月のマネタリーベース *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*2月の米貿易収支	*10年利付国債入札(26,000億円、4/3発行) *交付税特別会計借入(13,000億円、4/10借入)
--------------------------------------	-----------	---

◆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