

# Central Daily Market Report

2026年4月3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4月3日 需給速報	2026年4月6日 需給予想	2026年4月7日 当社予想	
銀行券	900	900	1,600	
財政	▲ 22,700	▲ 5,700	0	
資金過不足	▲ 21,800	▲ 4,800	1,600	
金融調節	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		4,100		
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	▲ 1,300	6,100	1,300	
※下月資金供給用担保提供供給				
当預増減	▲ 17,000	600	1,600	
当座預金残高	4,568,400	4,569,000	4,570,600	
準備預金残高	4,201,800			
積み終了先	4,201,800		4月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,201,800		積数	100
非準備預金先	366,600		1日平均	0
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	100.00%	日数	67.74%

## ●2026年4月3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、月内物を中心とする出合いが散見された。

### <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>

3日は、TDB3M物(第1372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堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

4/3	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	0.750	0.728	1W				T+0	0.750	
T/N				2W				T+1	0.754	
S/N				3W		0.850				
2日				1M	0.830	0.860	0.847	1W	0.748	
3日				2M				2W	0.748	
4日				3M	1.000	1.050	1.021	3W	0.749	
5日				4M			1.150	1M	0.757	
6日				5M				3M	0.878	
有担保コール(速報)				6M			6M	0.904	6M	0.924
翌日物			0.680	1Y			1Y	1.075	1Y	1.055

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	
2.380	▲ 0.010	53,123.49	+660.22	159.48-50	159.59-61	
日付		3/27	3/30	3/31	4/1	4/2
日銀当預残	4,553,400	4,585,700	4,597,800	4,568,700	4,585,400	
準備預金残	4,163,800	4,223,700	4,210,400	4,182,700	4,211,500	
マネタリーベース	5,764,500	5,796,100	5,807,000	5,777,900	5,794,100	
無担O/N加重平均	0.727%	0.726%	0.727%	0.728%	0.727%	
コール市場残高	113,581	111,897	96,925	114,032	113,553	
うち無担	88,587	87,611	73,237	90,298	89,971	
うちO/N	35,915	36,289	29,045	40,571	39,509	
うち有担	24,994	24,286	23,688	23,734	23,582	

## ●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非償付競争入札(億円)	非償付入札(億円)
国庫短期証券	1372	-	46,000	2026/4/6	2026/7/6	143,032	35,961.7	99.7805	0.8823%	91.9708%	99.7826	0.8738%	10,038	

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2026/4/6				4,456	1,000	0.018		0.025	51.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,300	2026/4/6				5,749	2,304	0.005		0.008	12.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	800	2026/4/6				1,941	801	0.019		0.034	36.7
国債買入(残存期間25年超)	750	2026/4/6				1,499	750	0.018		0.027	79.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/4/3	2026/4/6		0.550	1,395	1,395		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/4/3	2026/4/6		0.550	0	0				

## ●2026年4月6日の予定

\*Euro, London祝日(Easter Monday)

◆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