

Central Daily Market Report

2026年4月6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4月6日 需給速報	2026年4月7日 需給予想	2026年4月8日 当社予想			
銀行券	900	800	1,200			
財政	▲ 2,100	7,000	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 1,200	7,800	▲ 3,800			
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						
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						
国債補完供給	▲ 2,300	1,300	2,300			
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	1,900	10,100	▲ 3,800			
当座預金残高	4,570,300	4,580,400	4,576,600			
準備預金残高	4,187,300					
積み終了先	4,187,300			4月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,187,300			積数	100	
非準備預金先	383,000			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	70.97%		

●2026年4月6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、ショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<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>

6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、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

4/6	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	0.727	1W	0.731	0.850	0.747	T+0	0.750	
T/N				2W				T+1	0.755	
S/N				3W						
2日				1M	0.850	0.880	0.874	1W	0.750	
3日				2M				2W	0.750	
4日				3M				3W	0.750	
5日				4M				1M	0.767	
6日				5M				3M	0.888	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.928	
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.060	

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	
2.425	+0.045	53,413.68	+290.19	159.78-80	159.37-39	
日付	3/30	3/31	4/1	4/2	4/3	
日銀当預残	4,585,700	4,597,800	4,568,700	4,585,400	4,568,400	
準備預金残	4,223,700	4,210,400	4,182,700	4,211,500	4,201,800	
マネタリーベース	5,796,100	5,807,000	5,777,900	5,794,100	5,776,100	
無担O/N加重平均	0.726%	0.727%	0.728%	0.727%	0.728%	
コール市場残高	111,897	96,925	114,032	113,553	118,111	
うち無担	87,611	73,237	90,298	89,971	93,386	
うちO/N	36,289	29,045	40,571	39,509	41,864	
うち有担	24,286	23,688	23,734	23,582	24,725	

●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	オフア一額(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(午前オフア一分)		2026/4/6	2026/4/7		0.550	2,485	2,485		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア一分)		2026/4/6	2026/4/7		0.550	0	0				

●2026年4月7日の予定

*2月の全世帯家計調査	*2月の米消費者信用残高	*30年利付国債入札(6,000億円、4/8発行)
*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*2月の米耐久財受注	*交付税特別会計借入(9,000億円、4/16借入)
*2月の景気動向指数速報		

◆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