

Central Daily Market Report

2026年3月16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16日 需給速報	2026年3月17日 需給予想	2026年3月18日 当社予想			
銀行券	800	▲ 300	300			
財政	▲ 8,300	8,300	▲ 3,000			
資金過不足	▲ 7,500	8,000	▲ 2,700			
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			8,000			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)		▲ 50,000				
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 6,000	5,600		6,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 57,900	22,000				▲ 10,700
当座預金残高	4,404,400	4,426,400				4,415,700
準備預金残高	4,056,800					
積み終了先	1,855,000			3月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,007,800			積数		1,079,900
非準備預金先	347,600			1日平均		36,000
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	73.85%		日数		3.23%

●2026年3月16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、先週に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、0.75%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>

16日のアウトライイト市場では、3M、1Y物での出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の発行が観測された。
発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

3/16	無担保コール(速報)							短国		東京レポレート		JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時			
O/N	0.700	0.780	0.727	1W	0.728	0.730	0.729	T+0	0.750	2.275	+0.035	53,751.15	▲ 68.46	159.55-57	159.28-29		
T/N				2W			0.795	T+1	0.753								
S/N				3W													
2日				1M				1W	0.750								
3日				2M				2W	0.750								
4日				3M				3W	0.750								
5日				4M				1M	0.751								
6日				5M				3M	0.817								
有担保コール(速報)				6M				6M	0.865								
O/N			0.680	1Y				1Y	0.998								

日付	3/9	3/10	3/11	3/12	3/13
日銀当預残	4,480,500	4,484,600	4,487,200	4,460,400	4,462,300
準備預金残	4,137,100	4,126,200	4,127,100	4,095,000	4,097,800
マネタリーベース	5,694,700	5,697,900	5,700,100	5,672,900	5,674,600
無担O/N加重平均	0.727%	0.728%	0.727%	0.734%	0.728%
コール市場残高	125,434	124,741	123,281	125,225	123,373
うち無担	99,278	98,216	97,073	98,609	96,590
うちO/N	39,650	38,123	36,595	39,161	39,012
うち有担	26,156	26,525	26,208	26,616	26,783

●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1非価格競争入札(億円)	第1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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,700	2026/3/17				11,410	2,701	▲0.005		▲0.002	19.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,450	2026/3/17				5,146	2,455	▲0.012		▲0.009	67.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	2,600	2026/3/17				7,241	2,600	0.004		0.006	35.1
国債買入(残存期間25年超)	750	2026/3/17				1,570	753	0.046		0.056	77.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/3/16	2026/3/17		0.550	6,383	6,383			0.550	0.550
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/3/16	2026/3/17		0.550	94	94			0.550	0.550

●2026年3月17日の予定

*1月の第3次産業活動指数	*FOMC(1日目)	*国庫短期証券(1369回)入札(1年、31,000億円、3/23発行)
		*20年利付国債入札(8,000億円、3/18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