

Central Daily Market Report

2026年3月17日(火)
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17日 需給速報	2026年3月18日 需給予想	2026年3月19日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 400	▲ 1,000			
財政	5,600	▲ 6,100	17,000			
資金過不足	5,500	▲ 6,500	16,000			
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	8,000					
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	▲ 4,500	6,000		4,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	15,000	▲ 2,000				16,000
当座預金残高	4,419,400	4,417,400				4,433,400
準備預金残高	4,075,100					
積み終了先	3,844,500		3月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,244,800		積数		267,300	
非準備預金先	344,300		1日平均		9,200	
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	93.53%	日数		6.45%	

●2026年3月17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>

17日はTDB1Y物(第1369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。
この他、3M物、6M物でも出合いが見られた。

<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、横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

3/17 単位: %	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	売買取参考統計値	平均値		
O/N	0.700	0.780	0.727	1W	0.731	0.800	0.741	T+0	0.750	
T/N				2W				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			0.850	4M				1M	0.750	
6日				5M				3M	0.819	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.882	
O/N			0.680	1Y				1Y	1.001	

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	
2.265	▲ 0.010	53,700.39	▲ 50.76	159.12-15	159.22-24	
日付		3/10	3/11	3/12	3/13	3/16
日銀当預残	4,484,600	4,487,200	4,460,400	4,462,300	4,404,400	
準備預金残	4,126,200	4,127,100	4,095,000	4,097,800	4,056,100	
マネタリーベース	5,697,900	5,700,100	5,672,900	5,674,600	5,615,900	
無担O/N加重平均	0.728%	0.727%	0.734%	0.728%	0.727%	
コール市場残高	124,741	123,281	125,225	123,373	116,608	
うち無担	98,216	97,073	98,609	96,590	90,427	
うちO/N	38,123	36,595	39,161	39,012	33,749	
うち有担	26,525	26,208	26,616	26,783	26,181	

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1369	-	31,000	2026/3/23	2027/3/23	81,020	24,195.8	98.947	1.0642%	43.8490%	98.956	1.0550%	6,804	
20年利付国債	195	3.2%	8,000	2026/3/18	2045/12/20	19,903	6,130	100.65	3.146%	79.4755%	100.71	3.141%	1,863	

●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
米ドル資金供給		2026/3/19	2026/3/26	3.890		0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/3/17	2026/3/18		0.550	4,811	4,811		0.550	0.550	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2026/3/18	2026/4/1	0.750		27,704	8,011				28.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/3/17	2026/3/18		0.550	0	0				

●2026年3月18日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目)	*FOMC(2日目)	*国庫短期証券(1370回)入札 (3か月、47,000億円、3/23発行)
*10-12月期の資金循環統計速報	*FRB 米経済見通し	
*2月の貿易統計	*2月の米生産者物価指数	
*1月の石油等消費動態統計	*1月の米製造業受注	
	*2月のユーロ圏消費者物価指数改訂値	

◆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