

Central Daily Market Report

2026年3月18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3月18日 需給速報	2026年3月19日 需給予想	2026年3月23日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 300	1,000			
財政	▲ 10,500	24,100	99,000			
資金過不足	▲ 10,800	23,800	100,000			
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						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ						
国債補充供給	▲ 4,600	4,500		4,600		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 10,900	28,300		100,000		
当座預金残高	4,408,500	4,436,800		4,536,800		
準備預金残高	4,058,400					
積み終了先	3,969,100			3月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,910,800			積数	119,700	
非準備預金先	350,100			1日平均	4,300	
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	97.10%	日数	9.68%		

●2026年3月18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>

18日はTDB3M物(第1370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、1Y物でも出合いが見られた。

<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

3/18	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	0.780	0.727	1W	0.721	0.725	0.723	T+0	0.751	
T/N				2W				T+1	0.753	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.750	
3日				2M				2W	0.749	
4日				3M				3W	0.750	
5日				4M				1M	0.751	
6日				5M				3M	0.822	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.885	
O/N			0.680	1Y				1Y	1.003	

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	
2.214	▲ 0.051	55,239.40	+1,539.01	158.89-93	158.76-78	
日付		3/11	3/12	3/13	3/16	3/17
日銀当預残	4,487,200	4,460,400	4,462,300	4,404,400	4,419,400	
準備預金残	4,127,100	4,095,000	4,097,800	4,056,100	4,076,600	
マネタリーベース	5,700,100	5,672,900	5,674,600	5,615,900	5,631,100	
無担O/N加重平均	0.727%	0.734%	0.728%	0.727%	0.727%	
コール市場残高	123,281	125,225	123,373	116,608	116,155	
うち無担	97,073	98,609	96,590	90,427	90,768	
うちO/N	36,595	39,161	39,012	33,749	35,090	
うち有担	26,208	26,616	26,783	26,181	25,387	

●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	棄分率	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	1370	-	47,000	2026/3/23	2026/6/22	101,016	36,739.9	99,796.0	0.8199%	63.0013%	99.7992	0.8070%	10,260	

●オペ結果

種類	オフター額(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(午前オフター分)		2026/3/18	2026/3/19		0.550	5,047	5,047		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2026/3/18	2026/3/19		0.550	0	0				

●2026年3月19日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目)	*ECB理事会
*日銀総裁定例記者会見	*英中銀MPC
*1月の機械受注統計調査	*1月の米新規住宅販売件数
	*1月の米卸売売上高

◆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