

**<<資金需給>>**

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想	18日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	300	▲1,000
財政		▲8,000	8,500	4,000
資金過不足		▲7,000	8,800	3,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		65,430		
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入			10,000	
国庫短期証売却				
国債買入				
CP等買入		▲400	▲500	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 189,789				49,000
被災地支援				▲15,800
3,252				
社債等買入		▲200		1,000
ETF買入		300		
国債補完供給		200		
小計		▲100	9,500	34,200
当増減		▲7,100	18,300	37,200

当座預金残高	1,834,300	3/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,677,300		1,971,500
積み終了先	456,700	3/17以降の残り所要積立額	
超過準備	339,800	積数	927,800
非準預先残高	157,000	1日平均	30,900
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			1,971,500
準備預金進捗率	52.94% (実績)	3.23%	(日数)

3/13のマナターベース		2,777,900	
3/13コール合計	218,864	無担	87,798
コール前日増減	▲1,140	有担	131,066
		▲1,063	▲77

3/16の加重平均レート(速報)			3/13の加重平均レート(確報)		
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.060 ~0.130 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)		O/N 0.050 ~0.130 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.075 ~0.120 (0.095)			T/N	0.075 ~0.087 (0.077)	
0.100 (0.100)			S/N		
0.075 ~0.117 (0.108)			1W	0.070 ~0.260 (0.115)	
0.115 ~0.118 (0.118)			2W	0.114 (0.114)	
			3W		
0.200 (0.200)		0.08-0.13	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	2M		
		0.08-0.12	▲0.004	3M	
		-	▲0.013-▲0.012	6M	
		-	-	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	2,000億円	3/16 ~ 3/17 (1日間) 応札	31億円	落札	31億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
貸出増加支援	3/18~2016/3/18 (366日間)	貸付予定総額	5,441億円	貸付利率	0.10%				
貸出増加支援	3/18~2017/3/17 (730日間)	貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%				
貸出増加支援	3/18~2018/3/16 (1094日間)	貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%				
貸出増加支援	3/18~2019/3/18 (1461日間)	貸付予定総額	44,000億円	貸付利率	0.10%				

<< 3/17の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,852,600	前日比	18,300
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると見込まれる。					

<< 16日のインターバンク市場動向 >>  
午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比7,000億円減の138兆3,000億円(当座預金残高見込みは183兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.075~0.076%での調達で始まった。一巡後は0.07%台前半で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が見られた。

<< 16日のオープン市場動向 >>  
現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は閑散とした中、3M物で▲0.004%、6M物で▲0.013~▲0.012%での出合いが見られた程度であった。CP市場は石油・不動産業態からまとまった発行が見られたものの、発行案件が少なく、発行総額は900億円程度にとどまった。発行レートも特段変化は見られなかった。

- << 17日の材料 >>  
\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)  
\*黒田日銀総裁、定例会見  
\*1月の景気動向指数改訂状況  
\*米国FOMC(1日目) \*米国2月の住宅着工件数  
\*ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値

<<コール2月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07650%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07720%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	121.31-33
0.420	0.015	19,246.06	▲8.19
		為替(5時)	121.22-25

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	3/9	3/10	3/11	3/12	3/13	3/16
日銀当預残	1,817,000	1,819,800	1,835,700	1,833,800	1,841,400	1,834,300
準備預金残	1,658,000	1,665,100	1,669,000	1,673,000	1,679,400	1,677,300
レート	0.076%	0.076%	0.083%	0.076%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07556%	0.07560%	0.07627%	0.07625%	0.07600%	0.07594%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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