

●資金需給

単位：億円	2017年3月14日	2017年3月15日	2017年3月16日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	200	▲ 500	▲ 1,000
財政	3,000	▲ 15,600	7,000
資金過不足	3,200	▲ 16,100	6,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国庫短期証買入	2,500		
国債買入	10,300	5,300	
CP等買入		▲ 1,400	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 2,700	500	2,700
当預増減	13,700	▲ 9,500	6,000
当座預金残高	3,277,400	3,267,900	3,273,900
準備預金残高	2,955,900		
積み終了先	2,500,600	3月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,500,600	積数	0
非準備預金先	321,500	1日平均	0
積み期間 (2/16~3/15) の所要準備額			2,020,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 96.43%

●短期金融市場関連指標

2017/3/14	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.083	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.089
T/N			0.005				-	▲ 0.088
S/N							-	-
1W	0.001	0.005	0.003				-	▲ 0.118
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.119
3W							-	▲ 0.331
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.247
3M							▲ 0.350	▲ 0.163
6M							▲ 0.314	▲ 0.204
1Y							▲ 0.287	▲ 0.223

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.085	0.000	19,609.50	▲ 24.25	114.91-92	115.16-18
日付	3/7	3/8	3/9	3/10	3/13
日銀当預残	3,259,100	3,264,800	3,265,200	3,280,200	3,263,700
準備預金残	2,924,700	2,920,500	2,924,300	2,955,600	2,945,600
マネタリーベース	4,299,800	4,305,100	4,305,700	4,320,600	4,303,000
無担O/N加重平均	▲ 0.035%	▲ 0.032%	▲ 0.027%	▲ 0.029%	▲ 0.048%
コール市場残高	97,735	94,513	95,682	96,152	91,626
うち無担	77,184	75,297	75,232	76,583	70,855
うちO/N	55,648	54,142	53,927	56,317	48,178
うち有担	20,551	19,216	20,450	19,569	20,771

●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	素分率	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)
国庫短期証券	670	-	25,000	2017/3/21	2018/3/20	98,784.0	22,879.7	100.2500	▲0.2500%	6.0820%	100.2840	▲0.2839%	2,120.0
20年利付国債	160	0.70%	11,000	2017/3/21	2037/3/20	37,605.0	9,938.00	100.3500	0.6800%	32.8473%	100.4600	0.6730%	1,053.0

●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	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(午前オファー分)	60,000	2017/3/14	2017/3/15		2,597	2,597		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/3/16	2017/3/23	1.39	4	4				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2017/3/15	2017/3/24		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2017年3月15日の予定

*日銀金融政策委員会・金融政策決定会合 (1日目、16日まで) *1月の石油等消費動態統計	*国庫短期証券(671回)入札 (3か月、44,000億円、3/21発行)	*米国FOMC(2日目) *FRB経済見通し発表 *米国2月の消費者物価指数 *米国2月の小売売上高 *米国1月の企業在庫
---	--	---

◆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