

●資金需給

単位：億円	2017年3月22日		2017年3月23日		2017年3月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 1,400		▲ 2,000	
財政	▲ 6,100		1,700		17,000	
資金過不足	▲ 5,900		300		15,000	
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						
国債買現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			11,600			
CP等買入		▲ 400	5,000	▲ 300		
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				
E T F 買入	500					
国債補完供給	▲ 3,600	4,300		3,600		
当預増減	▲ 200		20,200		15,000	
当座預金残高	3,377,800		3,398,000		3,413,000	
準備預金残高	3,024,600					
積み終了先	2,513,800				3月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,513,700				積数 21,100	
非準備預金先	353,200				1日平均 900	
積み期間 (3/16~4/15) の所要準備額					2,243,400	
準備預金進捗率	実績 99.06%		日数 22.58%			

●短期金融市場関連指標

2017/3/22	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レボレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
単位：%	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	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.086	0.055	▲ 0.005	19,041.38	▲ 414.50	111.52-54	111.50-51
T/N			0.000				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.102						
2W	0.000	0.060	0.009				-	▲ 0.496						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.392						
1M							-	▲ 0.267						
3M							▲ 0.336	▲ 0.168						
6M							▲ 0.300	▲ 0.204						
1Y							▲ 0.289	▲ 0.223						
									日付	3/14	3/15	3/16	3/17	3/21
									日銀当預残	3,277,400	3,267,100	3,268,300	3,322,200	3,378,000
									準備預金残	2,956,200	2,947,200	2,935,700	2,981,400	3,042,500
									マネタリーベース	4,316,400	4,306,500	4,308,600	4,364,000	4,419,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.053%	▲ 0.046%	▲ 0.043%	▲ 0.039%	▲ 0.042%
									コール市場残高	93,883	93,807	87,500	99,230	94,238
									うち無担	73,699	74,129	68,168	80,195	73,401
									うちO/N	51,034	52,948	46,849	58,819	52,576
									うち有担	20,184	19,678	19,332	19,035	20,837

●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)
40年利付国債	9	0.40%	5,000	2017/3/24	2056/3/20	14,723.0	4,996.00		0.9350%	13.6363%			

●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)	172,349	2017/3/22	2017/3/23		3,453	3,453		▲0.500	▲0.500	

●2017年3月23日の予定

*米国2月の新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(672回)入札 (3ヶ月、44,000億円、3/27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