

●資金需給

単位：億円	2018年3月1日 需給速報	2018年3月2日 需給予想	2018年3月5日 当社予想
銀行券	▲ 900	▲ 300	1,000
財政	▲ 12,100	▲ 50,800	▲ 5,000
資金過不足	▲ 13,000	▲ 51,100	▲ 4,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			2,300
国債買現			▲ 2,300
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		8,700	
CP等買入	▲ 200	▲ 100	
貸出支援基金(成)		4,000	▲ 3,700
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	▲ 1,400	1,700	1,400
当預増減	▲ 12,900	▲ 40,800	▲ 4,000
当座預金残高	3,655,100	3,614,300	3,610,300
準備預金残高	3,208,000		
積み終了先	3,207,600		3月2日以降の残り所要積立額
超過準備	3,207,600		積数 1,800
非準備預金先	447,100		1日平均 100
積み期間 (2/16~3/15) の所要準備額			2,750,600
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数 50.00%

●短期金融市場関連指標

2018/3/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	▲ 0.073	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.128	0.050	0.005	21,724.47	▲ 343.77	106.63-65	106.80-81
T/N			0.000				-	▲ 0.109						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.028				-	▲ 0.142						
2W	▲ 0.015	0.020	0.003				-	▲ 0.143						
3W							-	▲ 0.149						
1M			0.000				-	▲ 0.195						
3M							▲ 0.203	▲ 0.168						
6M							▲ 0.170	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.177	▲ 0.167						
									日付	2/22	2/23	2/26	2/27	2/28
									日銀当預残	3,649,400	3,661,800	3,645,000	3,659,800	3,668,000
									準備預金残	3,211,900	3,219,400	3,196,900	3,209,000	3,212,900
									マネタリーベース	4,731,300	4,745,000	4,728,400	4,744,000	4,752,700
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.048%	▲0.053%
									コール市場残高	106,980	116,076	110,580	104,449	99,706
									うち無担	84,284	95,368	89,632	84,325	78,882
									うちO/N	54,924	58,168	51,432	54,265	49,572
									うち有担	22,696	20,708	20,948	20,124	20,824

●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)
国庫短期証券	742	-	44,200	2018/3/5	2018/6/4	150,451.6	35,780.8	100.0485	▲0.1944%	5.3015%	100.0527	▲0.2112%	8,419.0
10年利付国債	350	0.10%	23,000	2018/3/20	2028/3/20	84,303.0	18,595.0	100.3700	0.0620%	41.7549%	100.3800	0.0610%	4,389.0
交付税特会	-	-	10,500	2018/3/13	2018/9/13	184,766.0	10,500.13		0.0000%	5.6830%		0.0000%	

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2018/3/5	2018/3/19		2,320	2,320				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	57,785	2018/3/1	2018/3/2		1,366	1,366		▲0.600	▲0.600	

●2018年3月2日の予定

*1月の完全失業率(市場予想：2.7%)	*2月実績/3月見込み財政資金対民間収支
*1月の有効求人倍率(市場予想：1.6倍)	*2月のマネタリーベース
*2月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.8%)	

◆本資料は信頼できると思わ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