

●資金需給

単位：億円	2017年10月17日	2017年10月18日	2017年10月19日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	200	▲ 200	▲ 2,000
財政	▲ 5,700	1,500	▲ 10,000
資金過不足	▲ 5,500	1,300	▲ 12,000
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			
国債売現			
国庫短期証買入	7,500		
国債買入		10,000	
CP等買入	3,000	▲ 100	
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	100		
国債補完供給	▲ 100	700	100
当預増減	5,600	11,300	▲ 12,000
当座預金残高	3,705,800	3,717,100	3,705,100
準備預金残高	3,275,000		
積み終了先	3,159,700		
超過準備	2,839,000		
非準備預金先	430,800		
積み期間 (10/16~11/15) の所要準備額			3,019,500
準備預金進捗率	実績	95.25%	日数
			6.45%

●短期金融市場関連指標

2017/10/17	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レボレート
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	▲ 0.065	0.050	▲ 0.043				-	▲ 0.099
T/N							-	▲ 0.162
S/N							-	-
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.034				-	▲ 0.129
2W	▲ 0.038	0.018	▲ 0.010				-	▲ 0.124
3W							-	▲ 0.120
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.119
3M							▲ 0.185	▲ 0.129
6M							▲ 0.174	▲ 0.134
1Y							▲ 0.161	▲ 0.157

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)
0.065	0.005	21,336.12	80.56	112.18-20	112.12-13
日付	10/10	10/11	10/12	10/13	10/16
日銀当預残	3,614,300	3,637,200	3,647,200	3,710,300	3,700,200
準備預金残	3,211,900	3,233,000	3,233,500	3,289,900	3,274,300
マネタリーベース	4,669,300	4,691,100	4,701,900	4,765,100	4,754,400
無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.024%	▲ 0.021%	▲ 0.021%	▲ 0.043%
コール市場残高	93,907	96,044	96,741	97,344	91,372
うち無担	73,555	74,879	76,182	75,987	70,771
うちO/N	46,775	48,369	49,292	49,757	45,871
うち有担	20,352	21,165	20,559	21,357	20,601

●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)
20年利付国債	162	0.60%	10,000	2017/10/19	2037/9/20	32,437.0	8,001.00	100.1500	0.5910%	91.5000%	100.1700	0.5900%	1,989.0

●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)	31,000	2017/10/17	2017/10/18		78	78		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	982	2017/10/17	2017/10/18		33	33		▲ 0.500	▲ 0.500	
米ドル資金供給		2017/10/19	2017/10/26	1.66	2	2				

●2017年10月18日の予定

*櫻井日銀審議委員、 函館市金融経済懇談会にて講演	*米国ページブック *米国9月の住宅着工件数	*国庫短期証券(715回)入札 (1年、23,000億円、10/20発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、10/26借入)
------------------------------	---------------------------	--

◆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