

●資金需給

単位：億円	2017年11月7日 需給速報	2017年11月8日 需給予想	2017年11月9日 当社予想
銀行券	900	1,100	1,000
財政	1,800	▲ 300	▲ 3,000
資金過不足	2,700	800	▲ 2,000
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	1,000		
国債買入	7,300	6,800	
CP等買入		▲ 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		
当預増減	10,700	7,600	▲ 2,000
当座預金残高	3,683,900	3,691,500	3,689,500
準備預金残高	3,245,900		
積み終了先	3,245,700	11月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,245,700	積数	1,200
非準備預金先	438,000	1日平均	100
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額			
3,031,300			
準備預金進捗率			
実績 99.96% 日数 74.19%			

●短期金融市場関連指標

2017/11/7	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.106
T/N							-	▲ 0.109
S/N							-	-
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.035				-	▲ 0.131
2W							-	▲ 0.128
3W							-	▲ 0.128
1M							-	▲ 0.130
3M							▲ 0.210	▲ 0.137
6M							▲ 0.184	▲ 0.146
1Y							▲ 0.190	▲ 0.165

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)
0.025	0.005	22,937.60	389.25	113.76-78	114.16-17
日付	10/30	10/31	11/1	11/2	11/6
日銀当預残	3,694,100	3,704,100	3,701,200	3,696,800	3,673,200
準備預金残	3,267,900	3,257,600	3,264,100	3,254,000	3,241,600
マネタリーベース	4,755,800	4,766,600	4,764,400	4,761,300	4,736,400
無担O/N加重平均	▲ 0.040%	▲ 0.046%	▲ 0.044%	▲ 0.044%	▲ 0.046%
コール市場残高	92,084	87,678	92,504	104,814	98,807
うち無担	69,999	66,827	74,272	86,680	76,166
うちO/N	40,234	39,667	44,972	56,270	45,236
うち有担	22,085	20,851	18,232	18,134	22,641

●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)
流動性供給	249	-	3,000	2017/11/9		19,794.0	2,997.00		▲0.0180%	65.7831%		▲0.0200%	

●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
CP等買入	2,000	2017/11/10			7,176	1,990	▲0.001		0.000	78.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,364	2017/11/7	2017/11/8		7	7		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2017/11/9	2017/11/16	1.66	0	0				

●2017年11月8日の予定

*布野日銀審議委員、宮崎県金融経済懇談会にて講演	*国庫短期証券(719回)入札 (6ヶ月、23,000億円、11/10発行)
*9月の景気動向指数速報	*交付税特別会計借入 (10,500億円、11/16借入)
*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引	

◆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