

●資金需給

単位：億円	2018年2月1日	2018年2月2日	2018年2月5日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 100	1,000
財政	▲ 7,300	▲ 75,200	▲ 25,000
資金過不足	▲ 7,400	▲ 75,300	▲ 24,000
金融調節	スタート	スタート	スタート
貸出	エンド	エンド	エンド
全店共通			1,400
国債買現			▲ 1,400
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		8,700	
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		▲ 100	
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 600	100	600
当預増減	▲ 7,900	▲ 66,200	▲ 24,000
当座預金残高	3,678,300	3,612,100	3,588,100
準備預金残高	3,255,700		
積み終了先	3,255,400	2月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,255,200	積数	2,000
非準備預金先	422,600	1日平均	100
積み期間 (1/16~2/15) の所要準備額			3,062,000
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数
			54.84%

●短期金融市場関連指標

2018/2/1	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.079	0.090	0.010	23,486.11	387.82	109.18~20	109.58~60
T/N			0.000				-	▲ 0.074						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.180	0.022				-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.035	0.117	▲ 0.019				-	▲ 0.084						
3W	0.010	0.120	0.035				-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.030	0.002	▲ 0.009				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.159	▲ 0.116						
6M							▲ 0.140	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.158	▲ 0.159						
									日付	1/25	1/26	1/29	1/30	1/31
									日銀当預残	3,669,900	3,679,800	3,666,900	3,685,800	3,686,200
									準備預金残	3,229,400	3,240,100	3,245,900	3,264,700	3,247,100
									マネタリーベース	4,752,800	4,762,900	4,749,500	4,767,700	4,767,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.040%	▲ 0.043%	▲ 0.044%	▲ 0.050%
									コール市場残高	103,297	102,501	99,548	98,564	96,482
									うち無担	79,781	79,163	76,103	75,994	73,433
									うちO/N	48,581	48,433	46,263	46,654	46,068
									うち有担	23,516	23,338	23,445	22,570	23,049

●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	736	-	44,200	2018/2/5	2018/5/7	158,399.0	35,779.5	100.0375	▲0.1503%	4.1341%	100.0398	▲0.1595%	8,420.0
10年利付国債	349	0.10%	23,000	2018/2/5	2027/12/20	88,188.0	19,237.00	100.0900	0.0900%	72.9297%	100.1100	0.0880%	3,748.0

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2018/2/5	2018/2/19		1,430	1,430				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	61,661	2018/2/1	2018/2/2		575	575		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2018/2/1	2018/2/2		8	8		▲0.600	▲0.600	

●2018年2月2日の予定

*1月のマネタリーベース	*米国12月の製造業新規受注・出荷・在庫	*交付税特別会計借入
*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支	*米国1月の米雇用統計	(10,500億円、2/14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