

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成29年11月17日(金)分
《 資金需給 》

平成29年11月20日
[セントラル短資株式会社]

単位：億円

需給		予想	速報	確報	
	銀行券要因	-800	-800	-800	
	財政等要因	-2,000	-1,500	-1,500	
	資金過不足	-2,800	-2,300	-2,300	
金融調節	貸出				
	本店共通				
	全店共通				
	共通(固定) 2,979				
	手形売出				
	国債売現先				
	国債買現先				
	C P 買現先				
	国短買入				
	国庫短期証売却				
	国債買入	+10,000	+10,000	+10,000	
	C P 等買入	-100	-100	-100	
	社債買入				
	ETF買入	+500	+500	+500	
	被災地支援等 5,088				
	国債補完供給				
	貸出支援基金 (成長) 92,686 (増加) 529,457				
	小計	+10,400	+10,400	+10,400	
	当預増減	+7,600	+8,100	+8,100	
	当座預金残高		3,653,600	3,653,600	
準備預金残高	3,218,800		3,218,800		
積み終了先	3,200,100		3,200,100		
超過準備	3,035,000		3,035,000		
非準備先残高	434,800		434,800		
マネタリーベース			4,713,800		
(参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)			3,227,000		
積み期間の所要準備額(積数)			確報		
11/20日以降の残りに要積立額(積数)			38,300		
11/20日以降の残りに要積立額(1日平均)			1,500		
11/17日以降の残りに要積立額(積数)			589,500		
11/17日以降の残りに要積立額(1日平均)			20,300		
準備預金進捗率(%)		実績	98.70%	日数	13.33%

コール市場残高

コール市場	残高	前日比	(無担)	(前日比)	(有担)	(前日比)
全 国	107,627	+5,463	85,194	+5,082	22,433	+381
			(うち0/N)	(前日比)		
			48,334	+3,777		

コールレート実績

	有担保コールレート					
	当日分			トム・スポットスタート分		
	平均	最低	最高	平均	最低	最高
ON						
TN						
SN						
2日						
3日						
4日						
5日						
6日						

	無担保コールレート					
	当日スタート分			トム・スポットスタート分		
	平均	最低	最高	平均	最低	最高
ON	-0.048	-0.078	0.001			
TN						
SN						
2日						
3日						
4日				-0.040		
5日						
6日						
1W	-0.040			-0.038	-0.040	-0.035
2W	-0.035			-0.030		
3W						
1M				0.008	-0.035	0.050
2M						
3M						
4M						
5M						
6M						
7M						
8M						
9M						
10M						
11M						
1Y						

(参考)	
積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(積数)	2,946,200
積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(1日平均)	98,200

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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