

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成29年11月24日(金)分  
《 資金需給 》

平成29年11月27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                                 | -600   | -700      | -700      |        |
|                            | 財政等要因                                 | -3,800 | -3,200    | -3,200    |        |
|                            | 資金過不足                                 | -4,400 | -3,900    | -3,900    |        |
| 金融調節                       | 貸出                                    |        |           |           |        |
|                            | 本店共通                                  |        |           |           |        |
|                            | 全店共通                                  |        |           |           |        |
|                            | 共通(固定)<br>3,989                       |        |           |           |        |
|                            | 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                                  |        |           |           |        |
|                            | C P 等買入                               |        |           |           |        |
|                            |                                       | -300   | -300      | -300      |        |
|                            | 社債買入                                  | -200   | -200      | -200      |        |
|                            | ETF買入                                 | +100   | +100      | +100      |        |
|                            | 被災地支援等<br>5,087                       |        |           |           |        |
|                            | 国債補完供給                                |        | -200      | -200      |        |
|                            | 貸出支援基金<br>(成長) 92,686<br>(増加) 529,457 |        |           |           |        |
|                            | 小計                                    | -400   | -600      | -600      |        |
|                            | 当預増減                                  | -4,800 | -4,500    | -4,500    |        |
|                            | 当座預金残高                                |        | 3,629,100 | 3,629,100 |        |
|                            | 準備預金残高                                |        | 3,192,600 | 3,192,800 |        |
|                            | 積み終了先                                 |        | 3,191,600 | 3,191,700 |        |
|                            | 超過準備                                  |        | 3,191,100 | 3,191,200 |        |
| 非準預先残高                     | 436,500                               |        | 436,300   |           |        |
| マネタリーベース                   |                                       |        |           | 4,693,300 |        |
| (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |                                       |        |           | 3,194,000 |        |
| 積み期間の所要準備額(積数)             |                                       |        |           | 確報        |        |
| 11/27日以降の残り要積立額(積数)        |                                       |        |           | 8,500     |        |
| 11/27日以降の残り要積立額(1日平均)      |                                       |        |           | 400       |        |
| 11/24日以降の残り要積立額(積数)        |                                       |        |           | 13,100    |        |
| 11/24日以降の残り要積立額(1日平均)      |                                       |        |           | 600       |        |
| 準備預金進捗率(%)                 |                                       | 実績     | 99.71%    | 日数        | 36.67% |

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   | 95,403 | -2,676 | 73,388  | -2,018 | 22,015 | -658  |
|       |        |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |       |
|       |        |        | 42,718  | +1,152 |        |       |

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  | -0.054    | -0.075 | 0.001 |              |        |        |
| TN  |           |        |       | 0.000        |        |        |
| SN  |           |        |       |              |        |        |
| 2日  |           |        |       |              |        |        |
| 3日  |           |        |       |              |        |        |
| 4日  |           |        |       |              |        |        |
| 5日  |           |        |       |              |        |        |
| 6日  |           |        |       |              |        |        |
| 1W  |           |        |       | -0.044       | -0.045 | -0.040 |
| 2W  | -0.040    |        |       | -0.028       |        |        |
| 3W  |           |        |       |              |        |        |
| 1M  |           |        |       | 0.000        |        |        |
| 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