

●資金需給

単位：億円	2017年11月28日	2017年11月29日	2017年11月30日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 800	▲ 900	▲ 1,400
財政	2,900	▲ 5,300	▲ 600
資金過不足	2,100	▲ 6,200	▲ 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	2,500		
国債買入	3,200	6,100	
CP等買入		▲ 200	2,000
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	800	▲ 200	
E T F 買入	300	900	
国債補完供給			
当預増減	8,300	400	0
当座預金残高	3,645,800	3,646,200	3,646,200
準備預金残高	3,215,000		
積み終了先	3,214,400	11月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,214,400	積数	7,200
非準備預金先	430,800	1日平均	400
積み期間 (11/16~12/15) の所要準備額			2,946,200
準備預金進捗率	実績	99.76%	日数
			43.33%

●短期金融市場関連指標

2017/11/28	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.097
T/N			0.000				-	▲ 0.094
S/N							-	-
1W			0.001				-	▲ 0.119
2W			0.020				-	▲ 0.117
3W							-	▲ 0.120
1M			▲ 0.045				-	▲ 0.124
3M							▲ 0.238	▲ 0.139
6M							▲ 0.215	▲ 0.150
1Y							▲ 0.202	▲ 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)
0.035	0.005	22,486.24	▲ 9.75	111.13-14	111.30-31
日付	11/20	11/21	11/22	11/24	11/27
日銀当預残	3,625,800	3,641,000	3,633,600	3,629,100	3,637,500
準備預金残	3,189,900	3,205,500	3,199,200	3,192,800	3,204,800
マネタリーベース	4,686,000	4,702,400	4,697,100	4,693,300	4,701,700
無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.050%	▲ 0.054%	▲ 0.054%	▲ 0.053%
コール市場残高	99,764	96,623	98,079	95,403	97,132
うち無担	76,516	76,609	75,406	73,388	74,621
うちO/N	44,586	43,129	41,566	42,718	43,191
うち有担	23,248	20,014	22,673	22,015	22,511

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
40年利付国債	10	0.90%	5,000	2017/11/30	2057/3/20	14,990.0	4,995.0		1.0050%	63.8132%			
交付税特会	-	-	10,500	2017/12/6	2018/6/4	173,296.0	10,500.08		0.0000%	6.1012%		0.0000%	

●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)	10,000	2017/11/28	2017/11/29		18	18		▲ 0.600	▲ 0.600	
米ドル資金供給		2017/11/30	2017/12/7	1.64	0	0				

●2017年11月29日の予定

*中曽日銀副総裁、時事通信社主催金融懇話会にて講演	*米国ページブック
*10月の商業動態統計速報	*米国7-9月期のGDP改定値

◆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