

●資金需給

単位：億円	2017年12月14日	2017年12月15日	2017年12月18日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 2,800	▲ 2,500	▲ 3,000
財政	2,400	53,700	▲ 3,000
資金過不足	▲ 400	51,200	▲ 6,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			4,100
国債買現			▲ 2,500
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		9,700	
CP等買入	▲ 100	▲ 500	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)		28,900	▲ 14,500
被災地支援			
社債等買入	▲ 100	▲ 200	
E T F 買入	200	200	
国債補完供給	▲ 300	300	300
当預増減	▲ 400	75,100	▲ 4,400
当座預金残高	3,608,400	3,683,500	3,679,100
準備預金残高	3,195,800		
積み終了先	3,195,800	12月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,195,700	積数	100
非準備預金先	412,600	1日平均	100
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額			2,950,300
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			96.67%

●短期金融市場関連指標

2017/12/14	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.044
T/N			0.000				-	▲ 0.073
S/N							-	-
1W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.033				-	▲ 0.100
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.174
3W			0.060				-	▲ 0.155
1M							-	▲ 0.151
3M							▲ 0.176	▲ 0.126
6M							▲ 0.172	▲ 0.150
1Y							▲ 0.159	▲ 0.164

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)
0.045	0.000	22,694.45	▲ 63.62	112.76-77	112.76-77
日付	12/7	12/8	12/11	12/12	12/13
日銀当預残	3,587,500	3,595,600	3,585,900	3,607,100	3,608,800
準備預金残	3,183,400	3,195,200	3,203,000	3,220,900	3,212,200
マネタリーベース	4,662,800	4,673,000	4,664,600	4,687,600	4,690,900
無担O/N加重平均	▲ 0.043%	▲ 0.038%	▲ 0.036%	▲ 0.034%	▲ 0.032%
コール市場残高	94,260	93,943	90,366	89,538	92,251
うち無担	70,754	71,334	69,218	68,072	71,179
うちO/N	42,709	43,724	41,528	40,762	43,109
うち有担	23,506	22,609	21,148	21,466	21,072

●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	727	-	43,700	2017/12/18	2018/3/26	114,637.0	35,389.7	100.0480	▲0.1786%	25.3750%	100.0525	▲0.1954%	8,310.0
20年利付国債	163	0.60%	10,000	2017/12/20	2037/12/20	36,787.0	8,065.00	100.4500	0.5740%	60.4234%	100.4800	0.5730%	1,929.0

●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	2017/12/18	2018/1/4		4,112	4,112				
CP等買入	4,500	2017/12/19			9,761	4,490	▲0.006		▲0.002	72.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	96,250	2017/12/14	2017/12/15		324	324		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2017/12/14	2017/12/15		7	7		▲0.500	▲0.500	

●2017年12月15日の予定

*12月調査の日銀短観(概要及び要旨) 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+24	*米国11月の鉱工業生産・設備稼働率
--	--------------------

◆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