

●資金需給

単位：億円	2018年1月10日	2018年1月11日	2018年1月12日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	4,400	2,700	3,000
財政	▲ 2,900	2,100	▲ 44,000
資金過不足	1,500	4,800	▲ 41,000
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		10,000	
国債買入		3,000	
CP等買入		▲ 100	▲ 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			
E T F 買入	600	700	
国債補完供給	▲ 400	900	400
当預増減	2,500	18,800	▲ 41,000
当座預金残高	3,694,600	3,713,400	3,672,400
準備預金残高	3,299,400		
積み終了先	3,299,200	1月11日以降の残リ所要積立額	
超過準備	3,299,200	積数	800
非準備預金先	395,200	1日平均	200
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額			3,051,200
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数
			83.87%

●短期金融市場関連指標

2018/1/10	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レボレート	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.091	0.080	0.016	23,788.20	▲ 61.79	112.77-78	111.93-95
T/N	▲ 0.035	0.000	▲ 0.026				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.031				-	▲ 0.083						
2W							-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.093						
1M			0.000				-	▲ 0.095						
3M			0.001				▲ 0.136	▲ 0.115						
6M							▲ 0.130	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.156						
									日付	12/28	12/29	1/4	1/5	1/9
									日銀当預残	3,689,300	3,686,100	3,701,200	3,703,400	3,692,100
									準備預金残	3,260,300	3,232,400	3,269,700	3,284,400	3,290,800
									マネタリーベース	4,803,700	4,801,100	4,810,400	4,808,600	4,793,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.036%	▲ 0.062%	▲ 0.047%	▲ 0.042%	▲ 0.038%
									コール市場残高	102,155	80,591	93,029	100,302	96,793
									うち無担	79,222	58,175	70,300	77,086	73,786
									うちO/N	44,332	43,575	43,905	48,641	44,671
									うち有担	22,933	22,416	22,729	23,216	23,007

●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)
国庫短期証券	731	-	23,000	2018/1/12	2018/7/10	103,079.0	19,088.4	100.0610	▲0.1243%	13.8589%	100.0650	▲0.1324%	3,911.0
10年利付国債	349	0.10%	23,000	2018/1/12	2027/12/20	69,253.0	18,507.00	100.2000	0.0790%	65.5523%	100.2100	0.0780%	4,481.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	80,967	2018/1/10	2018/1/11		280	280		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	29,843	2018/1/10	2018/1/11		91	91		▲0.500	▲0.500	

●2018年1月11日の予定

*11月の景気動向指数速報	*米国12月の財政収支	*国庫短期証券(732回)入札
*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国12月の生産者物価指数	(3ヶ月、44,000億円、1/15発行)

◆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