

●資金需給

単位：億円	2018年1月17日	2018年1月18日	2018年1月19日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	1,400	500	0
財政	3,700	▲ 22,800	1,000
資金過不足	5,100	▲ 22,300	1,000
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			
国債買入	6,800		6,000
CP等買入		▲ 100	▲ 300
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			▲ 200
社債等買入			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 200	600	200
当預増減	12,200	▲ 22,400	6,800
当座預金残高	3,686,500	3,664,100	3,670,900
準備預金残高	3,250,000		
積み終了先	3,135,300	1月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,739,400	積数	159,900
非準備預金先	436,500	1日平均	5,500
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,066,300
準備預金進捗率	実績	94.79%	日数
			6.45%

●短期金融市場関連指標

2018/1/17	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.091
T/N			0.000				-	▲ 0.083
S/N							-	-
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.091
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.096
3W							-	▲ 0.096
1M							-	▲ 0.099
3M							▲ 0.139	▲ 0.118
6M							▲ 0.135	▲ 0.143
1Y							▲ 0.148	▲ 0.157

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)
0.080	0.005	23,868.34	▲ 83.47	110.38-39	110.76-77
日付	1/10	1/11	1/12	1/15	1/16
日銀当預残	3,694,600	3,711,800	3,670,100	3,651,000	3,674,300
準備預金残	3,299,400	3,314,800	3,275,600	3,249,600	3,237,700
マネタリーベース	4,791,100	4,805,600	4,761,200	4,739,900	4,761,000
無担O/N加重平均	▲ 0.036%	▲ 0.030%	▲ 0.027%	▲ 0.029%	▲ 0.042%
コール市場残高	107,253	102,523	100,907	105,747	99,697
うち無担	83,784	78,694	78,302	81,457	73,937
うちO/N	54,079	49,739	48,537	52,152	44,822
うち有担	23,469	23,829	22,605	24,290	25,760

●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	733	-	23,000	2018/1/22	2019/1/21	97,509.0	18,794.70	100.1370	▲0.1371%	63.5381%	100.1400	▲0.1401%	4,205.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	500	2018/1/19			2,442	500	0.013		0.019	50.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/1/19			9,839	2,505	0.003		0.004	3.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2018/1/19			12,116	3,003	0.004		0.005	15.2
CP等買入	2,500	2018/1/22			9,257	2,500	0.000		0.000	98.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,325	2018/1/17	2018/1/18		129	129		▲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	2018/1/17	2018/1/18		50	50		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2018/1/19	2018/1/25	1.92	0	0				

●2018年1月18日の予定

*米国12月の住宅着工件数	*国庫短期証券(734回)入札 (3ヶ月、44,000億円、1/22発行) *30年利付国債入札 (8,000億円、1/22発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、1/26借入)
---------------	--	---------------------------------

◆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