

●資金需給

単位：億円	2018年9月19日	2018年9月20日	2018年9月21日
需給速報	需給予想	当社予想	
銀行券	300	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	0	72,800	▲ 5,000
資金過不足	300	71,800	▲ 6,000
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	7,100		
CP等買入		▲ 300	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			800
社債等買入		▲ 500	1,000
E T F 買入		700	
国債補完供給	▲ 900	1,000	900
当預増減	7,000	72,600	▲ 5,000
当座預金残高	3,872,100	3,944,700	3,939,700
準備預金残高	3,394,000		
積み終了先	3,373,300		9月20日以降の残リ所要積立額
超過準備	3,368,000		積数
非準備預金先	478,100		1日平均
積み期間 (9/16~10/15) の所要準備額			2,987,900
準備預金進捗率	実績	98.64%	日数
			13.33%

●短期金融市場関連指標

2018/9/19	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	売買参考値	平均値
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.097
T/N			0.000				-	▲ 0.109
S/N							-	-
1W	▲ 0.036	▲ 0.028	▲ 0.033				-	▲ 0.111
2W							-	▲ 0.132
3W			0.040				-	▲ 0.128
1M							-	▲ 0.128
3M							▲ 0.131	▲ 0.133
6M							▲ 0.162	▲ 0.146
1Y							▲ 0.138	▲ 0.156

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)
0.115	0.005	23,672.52	251.98	112.28-29	112.32-33
日付	9/11	9/12	9/13	9/14	9/18
日銀当預残	3,852,400	3,842,900	3,850,100	3,847,100	3,865,100
準備預金残	3,388,100	3,377,000	3,383,000	3,396,200	3,388,800
マネタリーベース	4,944,800	4,934,700	4,942,800	4,940,500	4,957,400
無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.058%	▲0.058%	▲0.062%	▲0.064%
コール市場残高	118,788	116,083	109,338	107,732	113,506
うち無担	92,450	89,293	83,354	81,468	87,033
うちO/N	61,880	59,073	53,964	52,548	55,843
うち有担	26,338	26,790	25,984	26,264	26,473

●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	案分率	募入 平均価格	募入 平均利回	第1非価格 競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)	47,614	2018/9/19	2018/9/20		479	479		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	39,707	2018/9/19	2018/9/20		441	441		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月20日の予定

*4-6月期の資金循環統計速報	*米国8月の中古住宅販売	*20年利付国債入札 (10,000億円、9/21発行)
-----------------	--------------	------------------------------

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対2) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、長期国債の買入れを行う。その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて上下にある程度変動しうるものとし(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する)、買入れ額については、保有残高の増加額年間約80兆円をめどとしつつ、弾力的な買入れを実施する。 (2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。 ②CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。
◆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