

●資金需給

単位：億円	2018年9月20日	2018年9月21日	2018年9月25日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 900	▲ 700	0
財政	71,800	▲ 1,200	▲ 2,000
資金過不足	70,900	▲ 1,900	▲ 2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 1,400
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		5,000	
国債買入			
CP等買入	▲ 300	▲ 900	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援		800	▲ 800
社債等買入	▲ 500	1,000	
E T F 買入	700	300	
国債補完供給	▲ 1,000	900	1,000
当預増減	70,700	4,500	▲ 3,400
当座預金残高	3,942,800	3,947,300	3,943,900
準備預金残高	3,446,800		
積み終了先	3,438,000		9月21日以降の残り所要積立額
超過準備	3,433,900		積数
非準備預金先	496,000		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	99.08%	日数
			16.67%

●短期金融市場関連指標

2018/9/20	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.101
T/N			0.000				-	▲ 0.114
S/N							-	-
1W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.030				-	▲ 0.113
2W			0.001				-	▲ 0.130
3W							-	▲ 0.128
1M							-	▲ 0.128
3M							▲ 0.131	▲ 0.133
6M							▲ 0.162	▲ 0.146
1Y							▲ 0.137	▲ 0.155

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	0.000	23,674.93	2.41	112.32-34	112.20-22
日付	9/12	9/13	9/14	9/18	9/19
日銀当預残	3,842,900	3,850,100	3,847,100	3,865,100	3,872,100
準備預金残	3,377,000	3,383,000	3,396,200	3,388,800	3,394,000
マネタリーベース	4,934,700	4,942,800	4,940,500	4,957,400	4,964,100
無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.058%	▲0.062%	▲0.064%	▲0.064%
コール市場残高	116,083	109,338	107,732	113,506	102,017
うち無担	89,293	83,354	81,468	87,033	81,913
うちO/N	59,073	53,964	52,548	55,843	50,773
うち有担	26,790	25,984	26,264	26,473	20,104

●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)
20年利付国債	165	0.50%	10,000	2018/9/21	2038/6/20	33,402.0	8,285.00	97.8500	0.6220%	13.0174%	97.9100	0.6180%	1,705.0

●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
国庫短期証券買入	5,000	2018/9/21			22,483	5,006	0.002		0.004	3.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	153,835	2018/9/20	2018/9/21		942	942		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月21日の予定

*8月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想：前年同月比(除く生鮮) +0.9%)	*国庫短期証券(785回) 入札 (3ヶ月、42,700億円、9/25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