

●資金需給

単位：億円	2018年9月27日	2018年9月28日	2018年10月1日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 900	▲ 600	1,000
財政	▲ 11,000	2,200	▲ 23,000
資金過不足	▲ 11,900	1,600	▲ 22,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 1,900
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		9,200	
CP等買入	▲ 1,200	5,000	▲ 4,800
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	100	1,000	
国債補完供給	▲ 1,800	2,500	1,800
当預増減	▲ 12,300	13,800	▲ 23,900
当座預金残高	3,947,900	3,961,700	3,937,800
準備預金残高	3,462,800		
積み終了先	3,462,000		9月28日以降の残り所要積立額
超過準備	3,462,000		積数 9,000
非準備預金先	485,100		1日平均 500
積み期間 (9/16～10/15) の所要準備額			2,988,300
準備預金進捗率	実績	99.70%	日数 40.00%

●短期金融市場関連指標

2018/9/27	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.098
T/N							-	▲ 0.143
S/N							-	-
1W	▲ 0.036	▲ 0.035	▲ 0.035				-	▲ 0.127
2W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.023				-	▲ 0.123
3W							-	▲ 0.122
1M							-	▲ 0.125
3M							▲ 0.135	▲ 0.132
6M							▲ 0.150	▲ 0.145
1Y							▲ 0.147	▲ 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	▲ 0.005	23,796.74	▲ 237.05	112.71-72	112.60-61
日付	9/19	9/20	9/21	9/25	9/26
日銀当預残	3,872,100	3,942,800	3,946,000	3,958,000	3,960,200
準備預金残	3,394,000	3,446,800	3,456,000	3,470,300	3,472,900
マネタリーベース	4,964,100	5,035,800	5,039,600	5,051,400	5,053,800
無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.064%	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.062%
コール市場残高	102,017	112,261	119,408	114,922	118,212
うち無担	81,913	86,960	96,069	93,236	95,124
うちO/N	50,773	51,540	59,339	55,476	57,254
うち有担	20,104	25,301	23,339	21,686	23,088

●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)
今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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2018/9/28			8,156	3,008	▲0.003		▲0.002	98.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2018/9/28			8,442	3,502	▲0.005		▲0.004	74.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/9/28			4,840	1,811	▲0.010		▲0.009	97.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/9/28			1,710	501	▲0.011		▲0.010	89.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	72,894	2018/9/27	2018/9/28		1,123	1,123		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	48,330	2018/9/27	2018/9/28		604	604		▲0.600	▲0.600	

●2018年9月28日の予定

*決定会合における主な意見(9月18、19日分)	*米国8月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(786回)入札
*9月の都区部消費者物価指数(CPI)	*米国9月のシカゴPM景況感指数	(3ヶ月、43,000億円、10/1発行)
市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.9%	*ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値	*2年利付国債入札
*8月の完全失業率(市場予想：2.5%)	*英国4-6月期のGDP確報値	(21,000億円、10/1発行)
*8月の有効求人倍率(市場予想：1.63倍)		
*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報		
市場予想：前月比1.5%		
*8月の商業動態統計速報	*8月の住宅着工統計	

◆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