

●資金需給

単位：億円	2018年11月9日	2018年11月12日	2018年11月13日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	600	900	1,000
財政	▲ 6,700	▲ 10,200	2,000
資金過不足	▲ 6,100	▲ 9,300	3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,200	▲ 2,100
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		10,000	
CP等買入	2,000	▲ 200	▲ 200
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	1,000	300	
国債補完供給		100	
当預増減	▲ 3,200	900	3,000
当座預金残高	3,919,700	3,920,600	3,923,600
準備預金残高	3,437,000		
積み終了先	3,436,900		11月12日以降の残り所要積立額
超過準備	3,436,900		積数
非準備預金先	482,700		1日平均
積み期間 (10/16~11/15) の所要準備額			3,105,100
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数
			87.10%

●短期金融市場関連指標

2018/11/9	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.128
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.140
S/N							-	-
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.140
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.144
3W							-	▲ 0.147
1M							-	▲ 0.149
3M							▲ 0.240	▲ 0.153
6M							▲ 0.200	▲ 0.152
1Y							▲ 0.170	▲ 0.159

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)
0.120	0.000	22,250.25	▲ 236.67	113.95-97	113.84-86
日付	11/2	11/5	11/6	11/7	11/8
日銀当預残	3,908,100	3,917,700	3,922,900	3,920,900	3,922,900
準備預金残	3,426,300	3,432,800	3,439,100	3,436,100	3,444,000
マネタリーベース	5,007,900	5,016,700	5,021,100	5,018,400	5,020,600
無担O/N加重平均	▲ 0.071%	▲ 0.072%	▲ 0.071%	▲ 0.070%	▲ 0.071%
コール市場残高	109,205	93,410	89,153	91,190	104,800
うち無担	91,293	76,599	74,887	76,207	84,738
うちO/N	56,623	42,029	42,547	42,017	43,118
うち有担	17,912	16,811	14,266	14,983	20,062

●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	795	-	43,000	2018/11/12	2019/2/18	115,588.0	34,919.4	100.0645	▲0.2400%	83.5348%	100.0692	▲0.2575%	8,080.0
エネルギー対策	-	-	6,000	2018/11/20	2019/11/20	104,001.0	5,999.97		0.0000%	5.7693%		0.0000%	

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2018/11/12	2018/11/26		2,152	2,152				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2018/11/12			10,401	3,503	▲0.003		▲0.002	74.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2018/11/12			11,149	4,006	0.000		0.000	82.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2018/11/12			4,641	1,814	0.001		0.002	27.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2018/11/12			1,669	505	0.002		0.002	72.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	32,936	2018/11/9	2018/11/12		10	10		▲0.600	▲0.600	

●2018年11月12日の予定

*10月の企業物価指数	*New York祝日(Veterans Day, observed)
-------------	-------------------------------------

◆本資料は信頼できると思わ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