

●資金需給

単位：億円	2016年6月21日	2016年6月22日	2016年6月23日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 1,000	▲ 1,100	▲ 2,000
財政	▲ 6,500	▲ 800	▲ 4,000
資金過不足	▲ 7,500	▲ 1,900	▲ 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			
国庫短期証買入	17,600		
国債買入		5,300	
CP等買入		▲ 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		▲ 100	
E T F 買入	100	200	
国債補完供給	▲ 300	300	300
当預増減	9,800	3,700	▲ 6,000
当座預金残高	3,016,800	3,020,500	3,014,500
準備預金残高	2,724,700		
積み終了先	2,228,100	6月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,228,000	積数	20,000
非準備預金先	292,100	1日平均	800
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額			2,064,500
準備預金進捗率	実績	99.03%	日数
			20.00%

●短期金融市場関連指標

2016/6/21	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レボレート
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	▲ 0.085	▲ 0.010	▲ 0.059				-	▲ 0.055
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.046
S/N							-	-
1W	▲ 0.050	0.230	▲ 0.029				-	▲ 0.083
2W							-	▲ 0.110
3W							-	▲ 0.113
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.122
3M							▲ 0.251	▲ 0.180
6M							▲ 0.367	▲ 0.217
1Y							▲ 0.402	▲ 0.220

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)
▲ 0.145	0.005	16,169.11	203.81	103.81-83	104.46-48

日付	6/14	6/15	6/16	6/17	6/20
日銀当預残	2,885,600	2,938,000	2,938,200	2,949,100	3,007,000
準備預金残	2,600,400	2,648,900	2,637,900	2,657,400	2,727,300
マネタリーベース	3,880,000	3,933,000	3,934,300	3,946,600	4,004,700
無担O/N加重平均	▲ 0.050%	▲ 0.053%	▲ 0.057%	▲ 0.057%	▲ 0.057%
コール市場残高	70,084	72,915	55,689	67,322	69,720
うち無担	52,654	55,607	40,558	49,031	49,200
うち有担	17,430	17,308	15,131	18,291	20,520

●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	素分率	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)
流動性供給	216	-	5,000	2016/6/23	-	16,557.0	4,985.00		▲0.0010%	81.3840%		▲0.0020%	

●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)	35,400	2016/6/21	2016/6/22		217	217		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/6/21	2016/6/22		81	81		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/6/23	2016/6/30	0.88	2	2				

●2016年6月22日の予定

*米国5月の中古住宅販売

◆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