

●資金需給

単位：億円	2016年7月4日		2016年7月5日		2016年7月6日		
	需給速報		需給予想		当社予想		
銀行券	800		800		1,000		
財政	▲ 34,300		8,000		1,000		
資金過不足	▲ 33,500		8,800		2,000		
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	
貸出							
全店共通	2,800	▲ 4,200	100	▲ 600			
国債買現							
国庫短期証買入			20,000				
国債買入			12,700		3,900		
CP等買入		▲ 100		▲ 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			100				
国債補完供給	▲ 100			100			
当預増減	▲ 35,100		41,000		5,900		
当座預金残高	3,007,700		3,048,700		3,054,600		
準備預金残高	2,714,100						
積み終了先	2,238,200				7月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,238,200				積数		1,500
非準備預金先	293,600				1日平均		100
積み期間（6/16～7/15）の所要準備額						2,064,300	
準備預金進捗率	実績		99.93%		日数		63.33%

●短期金融市場関連指標

2016/7/4	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	▲ 0.075	0.000	▲ 0.057				-	▲ 0.081
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.090
S/N							-	-
1W	▲ 0.045	▲ 0.030	▲ 0.040				-	▲ 0.098
2W	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.047				-	▲ 0.101
3W							-	▲ 0.106
1M							-	▲ 0.115
3M							▲ 0.327	▲ 0.205
6M							▲ 0.284	▲ 0.227
1Y							▲ 0.316	▲ 0.233

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)
▲ 0.255	0.004	15,775.80	93.32	102.47-50	102.70-72

日付	6/27	6/28	6/29	6/30	7/1
日銀当預残	3,010,700	3,032,300	3,036,300	3,032,800	3,042,800
準備預金残	2,721,600	2,739,000	2,740,300	2,725,900	2,725,600
マネタリーベース	4,014,700	4,037,200	4,042,400	4,039,400	4,050,300
無担O/N加重平均	▲ 0.061%	▲ 0.062%	▲ 0.061%	▲ 0.064%	▲ 0.058%
コール市場残高	68,461	66,789	68,734	58,667	77,486
うち無担	47,549	45,835	48,776	43,033	57,069
うち有担	20,912	20,954	19,958	15,634	20,417

●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)	応募額 (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
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/7/6			2,829	701	0.010		0.017	25.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/7/6			8,353	2,004	▲ 0.008		▲ 0.006	67.4
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/7/6			4,246	1,200	▲ 0.036		▲ 0.031	70.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	1,974	2016/7/4	2016/7/5		67	67		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2016年7月5日の予定

*7月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札 (24,000億円、7/7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