

●資金需給

単位：億円	2016年7月27日	2016年7月28日	2016年7月29日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 1,200	▲ 1,000
財政	▲ 600	▲ 3,500	25,500
資金過不足	▲ 1,200	▲ 4,700	24,500
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			
国債買入	12,700		7,500
CP等買入		▲ 100	3,500
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			
国債補完供給	▲ 200	300	200
当預増減	11,200	▲ 4,700	35,500
当座預金残高	3,023,500	3,018,800	3,054,300
準備預金残高	2,720,800		
積み終了先	2,257,500	7月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,257,500	積数	11,900
非準備預金先	302,700	1日平均	600
積み期間 (7/16~8/15) の所要準備額			2,136,900
準備預金進捗率	実績	99.44%	日数 38.71%

●短期金融市場関連指標

2016/7/27	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	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.085
T/N	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.089
S/N							-	-
1W	▲ 0.020	▲ 0.003	▲ 0.014				-	▲ 0.108
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.115
3W			0.000				-	▲ 0.126
1M	▲ 0.020	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.153
3M							▲ 0.276	▲ 0.206
6M							▲ 0.289	▲ 0.234
1Y							▲ 0.305	▲ 0.235

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)
▲ 0.298	▲ 0.039	16,664.82	281.78	104.84-87	105.39-41

日付	7/20	7/21	7/22	7/25	7/26
日銀当預残	2,967,400	3,010,400	2,997,700	2,999,900	3,012,300
準備預金残	2,669,600	2,708,700	2,700,600	2,710,200	2,707,300
マネタリーベース	3,971,800	4,015,800	4,004,900	4,007,800	4,021,200
無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.035%	▲0.030%	▲0.033%	▲0.029%
コール市場残高	71,811	71,278	76,492	72,430	76,795
うち無担	51,722	51,274	56,313	52,278	57,022
うち有担	20,089	20,004	20,179	20,152	19,773

●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5年超10年以下)	4,300	2016/7/29			10,233	4,306	▲0.035		▲0.032	95.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/7/29			5,429	2,002	▲0.043		▲0.037	65.3
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/7/29			3,705	1,203	▲0.055		▲0.050	52.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,675	2016/7/27	2016/7/28		207	207		▲0.500	▲0.500	

●2016年7月28日の予定

*日銀銀政策委員会・金融政策決定会合 (1日目、29日まで)	*国庫短期証券(623回)入札 (3ヶ月、44,000億円、8/1発行) *2年利付国債入札 (23,000億円、8/15発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、8/9借入)
-----------------------------------	---	--------------------------------

◆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