

●資金需給

単位：億円	2016年8月2日 需給速報	2016年8月3日 需給予想	2016年8月4日 当社予想
銀行券	700	600	0
財政	▲ 13,200	▲ 46,700	▲ 22,000
資金過不足	▲ 12,500	▲ 46,100	▲ 22,000
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		12,500	
国債買入		9,000	
CP等買入		▲ 100	
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	300		
国債補完供給	▲ 300	200	300
当預増減	▲ 12,500	▲ 24,500	▲ 22,000
当座預金残高	2,996,200	2,971,700	2,949,700
準備預金残高	2,700,000		
積み終了先	2,241,600	8月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,241,200	積数	5,200
非準備預金先	296,200	1日平均	400
積み期間 (7/16~8/15) の所要準備額			2,139,400
準備預金進捗率	実績	99.76%	日数 58.06%

●短期金融市場関連指標

2016/8/2	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	▲ 0.080	0.010	▲ 0.039				-	▲ 0.084
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.086
S/N							-	-
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.095
2W							-	▲ 0.098
3W							-	▲ 0.102
1M							-	▲ 0.105
3M							▲ 0.275	▲ 0.179
6M							▲ 0.260	▲ 0.229
1Y							▲ 0.273	▲ 0.229

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)
▲ 0.065	0.075	16,391.45	▲ 244.32	102.30-32	101.66-68

日付	7/26	7/27	7/28	7/29	8/1
日銀当預残	3,012,300	3,023,500	3,018,300	3,027,900	3,008,700
準備預金残	2,707,300	2,720,800	2,704,700	2,713,700	2,702,300
マネタリーベース	4,021,200	4,033,000	4,029,200	4,039,500	4,019,300
無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.028%	▲ 0.031%	▲ 0.046%	▲ 0.040%
コール市場残高	76,795	80,999	82,437	73,883	74,283
うち無担	57,022	61,124	63,144	54,184	55,538
うち有担	19,773	19,875	19,293	19,699	18,745

●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)
10年利付国債	343	0.10%	24,000	2016/8/4	2026/6/20	68,760.0	21,752.0	101.1900	▲0.0200%	76.6086%	101.4600	▲0.0470%	2,234.0

●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)	66,060	2016/8/2	2016/8/3		251	251		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/8/4	2016/8/12	0.89	0	0				

●2016年8月3日の予定

*6月の日銀銀当座預金増減要因見込み *日銀金融政策決定会合議事要旨 (6月15、16日開催分)	*米国7月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入 (10,500億円、8/12借入)
--	-------------------	---------------------------------

◆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