

●資金需給

単位：億円	2016年11月14日 需給速報	2016年11月15日 需給予想	2016年11月16日 当社予想
銀行券	900	500	1,000
財政	▲ 24,500	▲ 3,300	▲ 1,000
資金過不足	▲ 23,600	▲ 2,800	0
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,900	▲ 2,700	
国債買現			
国庫短期証買入		15,000	
国債買入		11,700	
CP等買入		▲ 600	
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	300	100	
国債補完供給	▲ 200	200	
当預増減	▲ 24,800	23,600	0
当座預金残高	3,139,400	3,163,000	3,163,000
準備預金残高	2,839,100		
積み終了先	2,382,500		11月15日以降の残り所要積立額
超過準備	2,382,500		積数
非準備預金先	300,300		1日平均
積み期間 (10/16~11/15) の所要準備額			2,170,600
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数

●短期金融市場関連指標

2016/11/14	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	▲ 0.053				-	▲ 0.094
T/N			0.000				-	▲ 0.091
S/N							-	-
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.096
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.096
3W							-	▲ 0.103
1M							-	▲ 0.107
3M							▲ 0.277	▲ 0.148
6M							▲ 0.295	▲ 0.225
1Y							▲ 0.300	▲ 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)
▲ 0.020	0.014	17,672.62	297.83	106.88-89	107.64-66

日付	11/7	11/8	11/9	11/10	11/11
日銀当預残	3,167,100	3,190,900	3,200,600	3,151,500	3,164,200
準備預金残	2,848,600	2,863,500	2,870,700	2,861,600	2,855,500
マネタリーベース	4,182,900	4,205,300	4,214,200	4,164,700	4,177,300
無担O/N加重平均	▲ 0.044%	▲ 0.044%	▲ 0.049%	▲ 0.050%	▲ 0.050%
コール市場残高	88,471	88,953	91,354	94,367	94,470
うち無担	70,136	70,231	72,578	74,550	75,947
うち有担	18,335	18,722	18,776	19,817	18,523

●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	棄分率	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)
預借借入(機能)	-	-	935	2016/11/25	2017/11/24	6,251.0	935.00		0.0000%	19.1360%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	26,388	2016/11/14	2016/11/15		43	43		▲ 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	2016/11/14	2016/11/15		200	200		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2016年11月15日の予定

*9月の石油等消費動態統計	*10月の米小売売上高 *9月の米企業在庫 *7-9月期のユーロ圏GDP2次速報 *10月の英消費者物価指数	*5年利付国債入札 (24,000億円、11/17発行) *国有林野借入 (662億円、11/25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