

●資金需給

単位：億円	2016年8月24日	2016年8月25日	2016年8月26日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 800	▲ 2,000
財政	▲ 2,300	▲ 12,100	0
資金過不足	▲ 2,400	▲ 12,900	▲ 2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出	スタート	エンド	スタート
全店共通			
国債買現			
国庫短期証買入			
国債買入			11,400
CP等買入	▲ 500	▲ 300	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			900
社債等買入		1,000	▲ 400
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 300	200	300
当預増減	▲ 3,000	▲ 12,000	9,900
当座預金残高	3,028,900	3,016,900	3,026,800
準備預金残高	2,728,300		
積み終了先	2,260,900	8月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,260,800	積数	14,600
非準備預金先	300,600	1日平均	700
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額			2,142,600
準備預金進捗率	実績	99.32%	日数 29.03%

●短期金融市場関連指標

2016/8/24	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レボレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.088	▲ 0.085	0.010	16,597.30	99.94	100.30-31	100.28-29
T/N	▲ 0.001	0.001	0.001				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.088						
2W			0.001				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.237	▲ 0.140						
6M							▲ 0.255	▲ 0.224						
1Y							▲ 0.276	▲ 0.225						
									日付	8/17	8/18	8/19	8/22	8/23
									日銀当預残	3,038,400	3,034,200	3,045,900	2,992,400	3,031,900
									準備預金残	2,739,900	2,740,400	2,737,200	2,703,900	2,728,800
									マネタリーベース	4,046,600	4,042,900	4,054,700	4,000,800	4,040,500
									無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.045%	▲0.047%	▲0.045%	▲0.046%
									コール市場残高	79,155	75,561	77,303	71,394	79,528
									うち無担	59,834	56,091	57,869	51,563	59,691
									うち有担	19,321	19,470	19,434	19,831	19,837

●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年超3年以下)	4,000	2016/8/26			10,562	4,005	0.002		0.003	67.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/8/26			12,010	4,201	0.002		0.002	97.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/8/26			7,156	2,004	▲ 0.011		▲ 0.009	58.0
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/8/26			4,464	1,203	▲ 0.007		▲ 0.004	87.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	50,000	2016/8/24	2016/8/25		320	320		▲ 0.500	▲ 0.500	

●2016年8月25日の予定

*7月の企業向けサービス価格指数 *米国7月の耐久財新規受注	*国庫短期証券(629回)入札 (3ヶ月、44,000億円、8/29発行) *流動性供給入札 (5,000億円、8/29発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、9/2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