

●資金需給

単位：億円	2016年8月30日	2016年8月31日	2016年9月1日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	300	200	0
財政	1,400	900	▲ 9,000
資金過不足	1,700	1,100	▲ 9,000
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	10,000		
国債買入	5,300	11,700	
CP等買入		▲ 600	▲ 2,900
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		▲ 200	▲ 100
E T F買入			
国債補完供給	▲ 400	400	400
当預増減	16,200	13,700	▲ 9,000
当座預金残高	3,023,300	3,037,000	3,028,000
準備預金残高	2,736,000		
積み終了先	2,272,900		8月31日以降の残り所要積立額
超過準備	2,272,900		積数
非準備預金先	287,300		1日平均
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			2,141,800
準備預金進捗率	実績	99.69%	日数
			48.39%

●短期金融市場関連指標

2016/8/30	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.091
T/N	▲ 0.050	▲ 0.002	▲ 0.029				-	▲ 0.095
S/N							-	-
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.089
2W							-	▲ 0.090
3W							-	▲ 0.094
1M							-	▲ 0.103
3M							▲ 0.249	▲ 0.137
6M							▲ 0.255	▲ 0.219
1Y							▲ 0.262	▲ 0.220

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)
▲ 0.078	▲ 0.008	16,725.36	▲ 12.13	101.82-85	102.36-38

日付	8/23	8/24	8/25	8/26	8/29
日銀当預残	3,031,900	3,028,900	3,016,400	3,027,800	3,007,100
準備預金残	2,728,800	2,728,300	2,725,700	2,734,400	2,727,000
マネタリーベース	4,040,500	4,037,500	4,026,000	4,038,500	4,018,000
無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.047%	▲ 0.047%	▲ 0.044%	▲ 0.046%
コール市場残高	79,528	76,662	76,280	75,763	72,646
うち無担	59,691	57,181	56,532	56,447	53,635
うち有担	19,837	19,481	19,748	19,316	19,011

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
2年利付国債	368	0.10%	23,000	2016/9/15	2018/9/15	92,517.0	20,843.0	100.5850	▲ 0.1910%	22.2434%	100.5890	▲ 0.1930%	2,148.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/9/7	2017/3/7	95,392.0	10,500.00		0.0010%	11.0073%		0.0010%	

●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)	12,837	2016/8/30	2016/8/31		127	127		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/8/30	2016/8/31		233	233		▲ 0.500	▲ 0.500	
米ドル資金供給		2016/9/1	2016/9/9	0.88	0	0				

●2016年8月31日の予定

*布野日銀審議委員、新潟県金融経済懇談会にて講演	*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+0.8%) *7月の住宅着工統計	*米国8月のシカゴPM景況感指数 *ユーロ圏8月の消費者物価指数速報値
--------------------------	--	--

◆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