

●資金需給

単位：億円	2016年9月14日		2016年9月15日		2016年9月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 1,000		▲ 2,000	
財政	▲ 4,100		▲ 11,100		5,000	
資金過不足	▲ 4,400		▲ 12,100		3,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,700				11,400	
CP等買入		▲ 300		▲ 1,000	5,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					54,400	▲ 8,400
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 3,600	200		3,600		
当預増減	▲ 3,500		▲ 9,600		65,400	
当座預金残高	3,036,900		3,027,300		3,092,700	
準備預金残高	2,725,600					
積み終了先	2,273,100		9月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,273,100		積数		0	
非準備預金先	311,300		1日平均		0	
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額					2,149,000	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.77%		

●短期金融市場関連指標

2016/9/14	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
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.100
T/N	▲ 0.070	0.000	▲ 0.066				-	▲ 0.105
S/N							-	-
1W	▲ 0.040	0.230	▲ 0.017				-	▲ 0.110
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.112
3W			0.040				-	▲ 0.144
1M							-	▲ 0.145
3M							▲ 0.328	▲ 0.160
6M							▲ 0.321	▲ 0.225
1Y							▲ 0.354	▲ 0.226

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	0.000	16,614.24	▲ 114.80	102.49-51	103.12-14

日付	9/7	9/8	9/9	9/12	9/13
日銀当預残	3,029,700	3,030,300	3,043,700	3,020,600	3,040,400
準備預金残	2,724,200	2,728,000	2,735,300	2,722,800	2,738,700
マネタリーベース	4,037,100	4,037,400	4,050,500	4,026,300	4,045,700
無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.047%	▲ 0.046%	▲ 0.049%	▲ 0.057%
コール市場残高	82,837	83,162	87,444	76,637	76,824
うち無担	63,775	64,749	68,717	58,094	57,511
うち有担	19,062	18,413	18,727	18,543	19,313

●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)
国庫短期証券	633	-	25,000	2016/9/20	2017/9/20	99,775.0	22,763.8	100.3230	▲ 0.3219%	51.0769%	100.3410	▲ 0.3398%	2,236.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/9/16			11,114	4,002	▲0.038		▲0.035	86.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/9/16			9,344	4,201	▲0.032		▲0.027	40.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/9/16			4,601	2,002	0.042		0.054	89.5
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/9/16			2,654	1,201	0.030		0.056	45.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	146,274	2016/9/14	2016/9/15		3,072	3,072		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	45,673	2016/9/14	2016/9/15		281	281		▲0.600	▲0.600	

種類		スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
貸出増加支援オペ	貸付期間1年(借り換え)	2016/9/16	2017/9/15	0	4,908
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2016/9/16	2020/9/16	0	49,502

●2016年9月15日の予定

*7月の石油等消費動態統計 *英中銀MPC結果発表 *ユーロ圏8月の圏消費者物価指数改定値	*米国7月の企業在庫 *米国8月の生産者物価指数 *米国8月の小売売上高 *米国8月の鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(634回)入札 (3ヶ月、44,000億円、9/20発行) *流動性供給入札 (2,000億円、9/20発行)
---	---	--

◆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録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