

●資金需給

単位：億円	2016年9月28日	2016年9月29日	2016年9月30日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	0	▲ 800	▲ 1,200
財政	▲ 8,900	▲ 6,400	2,700
資金過不足	▲ 8,900	▲ 7,200	1,500
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			
国債買入	13,000		11,400
CP等買入		▲ 700	5,500
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	1,100	
国債補完供給	▲ 600	800	600
当預増減	4,000	▲ 6,200	18,400
当座預金残高	3,129,500	3,123,300	3,141,700
準備預金残高	2,826,400		
積み終了先	2,357,800	9月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,357,800	積数	7,600
非準備預金先	303,100	1日平均	500
積み期間 (9/16~10/15) の所要準備額			2,072,900
準備預金進捗率	実績	99.63%	日数
			43.33%

●短期金融市場関連指標

2016/9/28	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.083
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.078
S/N							-	-
1W							-	▲ 0.180
2W							-	▲ 0.142
3W							-	▲ 0.137
1M							-	▲ 0.134
3M							▲ 0.342	▲ 0.170
6M							▲ 0.317	▲ 0.224
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)
▲ 0.095	▲ 0.015	16,465.40	▲ 218.53	100.49-51	100.75-76

日付	9/20	9/21	9/23	9/26	9/27
日銀当預残	3,096,200	3,119,000	3,121,800	3,126,000	3,125,500
準備預金残	2,788,400	2,818,600	2,814,400	2,819,600	2,818,300
マネタリーベース	4,104,900	4,128,600	4,131,700	4,135,000	4,134,500
無担O/N加重平均	▲ 0.060%	▲ 0.061%	▲ 0.054%	▲ 0.050%	▲ 0.045%
コール市場残高	70,748	72,540	73,065	74,490	78,269
うち無担	51,149	52,639	53,108	53,617	57,501
うち有担	19,599	19,901	19,957	20,873	20,768

●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	2016/9/30			10,144	4,002	▲ 0.034		▲ 0.030	72.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/9/30			13,205	4,206	▲ 0.012		▲ 0.010	21.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/9/30			5,514	2,003	▲ 0.027		▲ 0.021	45.2
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/9/30			2,567	1,201	▲ 0.029		▲ 0.021	98.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	44,983	2016/9/28	2016/9/29		630	630		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	830	2016/9/28	2016/9/29		4	4		▲ 0.500	▲ 0.500	

●2016年9月29日の予定

*黒田日銀総裁、全国証券大会にて講演 *8月の商業動態統計速報 *米国4-6月期のGDP確報値	*国庫短期証券(636回)入札 (3ヶ月、44,000億円、10/3発行)	*2年利付国債入札 (23,000億円、10/17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