

●資金需給

単位：億円	2016年11月11日	2016年11月14日	2016年11月15日
需給速報	需給予想	当社予想	
銀行券	100	1,000	2,000
財政	5,100	▲ 24,200	▲ 6,000
資金過不足	5,200	▲ 23,200	▲ 4,000
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	4,500		11,200
CP等買入	3,000	▲ 800	▲ 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	700	300	
国債補完供給		100	
当預増減	12,700	▲ 24,200	22,200
当座預金残高	3,164,200	3,140,000	3,162,200
準備預金残高	2,855,500		
積み終了先	2,395,400	11月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,395,300	積数	300
非準備預金先	308,700	1日平均	200
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
			93.55%

●短期金融市場関連指標

2016/11/11	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	▲ 0.050				-	▲ 0.098
T/N			0.000				-	▲ 0.092
S/N							-	-
1W			0.000				-	▲ 0.098
2W							-	▲ 0.098
3W							-	▲ 0.103
1M							-	▲ 0.107
3M							▲ 0.277	▲ 0.149
6M							▲ 0.296	▲ 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)
▲ 0.034	0.015	17,374.79	30.37	106.82-83	106.69-70

日付	11/4	11/7	11/8	11/9	11/10
日銀当預残	3,186,200	3,167,100	3,190,900	3,200,600	3,151,500
準備預金残	2,866,400	2,848,600	2,863,500	2,870,700	2,861,600
マネタリーベース	4,203,500	4,182,900	4,205,300	4,214,200	4,164,700
無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.044%	▲0.044%	▲0.049%	▲0.050%
コール市場残高	96,090	88,471	88,953	91,354	94,367
うち無担	78,122	70,136	70,231	72,578	74,550
うち有担	17,968	18,335	18,722	18,776	19,817

●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 最低値	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)
エネルギー対策	-	-	5,000	2016/11/21	2017/11/20	34,422.0	4,999.99		0.0000%	14.6487%		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
国庫短期証券買入	15,000	2016/11/15			37,322	15,000	0.011		0.012	88.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/11/15			13,418	4,004	0.014		0.015	22.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/11/15			9,052	4,207	0.015		0.017	46.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/11/15			4,330	1,909	0.011		0.014	47.8
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/11/15			2,583	1,101	0.017		0.021	36.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,633	2016/11/11	2016/11/14		43	43		▲0.600	▲0.600	

●2016年11月14日の予定

*黒田日銀総裁、 名古屋での経済界代表者との懇談にて講演	*7-9月期のGDP1次速報 (市場予想：前期比年率+0.9%)	*9月のマネタリーサーバイ
---------------------------------	-------------------------------------	---------------

◆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