

●資金需給

単位：億円	2016年12月9日	2016年12月12日	2016年12月13日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 2,200	▲ 800	▲ 1,000
財政	▲ 3,600	▲ 28,100	▲ 2,000
資金過不足	▲ 5,800	▲ 28,900	▲ 3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,000	▲ 2,900
国債買現			
国庫短期証買入			12,500
国債買入	12,800		11,200
CP等買入	4,500	▲ 500	▲ 400
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	
E T F 買入	700	300	
国債補完供給	▲ 100	300	100
当預増減	11,700	▲ 29,800	20,700
当座預金残高	3,125,500	3,095,700	3,116,400
準備預金残高	2,810,400		
積み終了先	2,372,100	12月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,372,100	積数	700
非準備預金先	315,100	1日平均	200
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額			2,122,300
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数
			86.67%

●短期金融市場関連指標

2016/12/9	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レボレート
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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.098
T/N							-	▲ 0.091
S/N							-	-
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.101
2W							-	▲ 0.104
3W							-	▲ 0.157
1M							-	▲ 0.149
3M							▲ 0.443	▲ 0.149
6M							▲ 0.369	▲ 0.225
1Y							▲ 0.306	▲ 0.228

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)
0.050	0.010	18,996.37	230.90	114.05-08	114.43-45

日付	12/2	12/5	12/6	12/7	12/8
日銀当預残	3,104,100	3,098,400	3,115,700	3,119,300	3,113,800
準備預金残	2,790,200	2,768,100	2,806,400	2,799,800	2,801,700
マネタリーベース	4,129,000	4,123,800	4,142,500	4,147,300	4,144,200
無担O/N加重平均	▲ 0.049%	▲ 0.052%	▲ 0.054%	▲ 0.056%	▲ 0.053%
コール市場残高	86,438	85,769	84,815	84,688	82,456
うち無担	65,705	64,184	63,730	63,029	60,547
うち有担	20,733	21,585	21,085	21,659	21,909

●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	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	-	-	6,000	2016/12/20	2017/12/20	37,096.0	5,999.95		0.0000%	16.3013%		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	12,500	2016/12/13			38,719	12,500	0.030		0.031	52.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2016/12/13			9,962	4,001	▲ 0.008		▲ 0.006	96.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2016/12/13			11,599	4,207	▲ 0.004		▲ 0.003	94.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2016/12/13			5,480	1,900	0.035		0.044	90.0
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2016/12/13			2,629	1,101	0.038		0.045	81.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	49,465	2016/12/9	2016/12/12		50	50		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2016年12月12日の予定

*10月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+1.0%)	*米国11月の財政収支
*10月の第3次産業活動指数	
*11月の企業物価指数	

◆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