

●資金需給

単位：億円	2016年12月16日	2016年12月19日	2016年12月20日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 3,100	▲ 2,600	▲ 4,000
財政	3,300	▲ 4,000	60,000
資金過不足	200	▲ 6,600	56,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		1,600	▲ 1,500
国債買現			
国庫短期証買入			
国債買入	16,300		3,900
CP等買入	4,500	▲ 300	
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	500		
国債補完供給	▲ 200	300	200
当預増減	21,400	▲ 6,600	59,900
当座預金残高	3,259,900	3,253,300	3,313,200
準備預金残高	2,926,800		
積み終了先	2,406,000	12月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,768,300	積数	78,500
非準備預金先	333,100	1日平均	2,800
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額			2,198,900
準備預金進捗率	実績	96.43%	日数
			9.68%

●短期金融市場関連指標

2016/12/16	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.090	0.075	0.000	19,401.15	127.36	118.24-27	118.20-21
T/N			0.010				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.031				-	▲ 0.100						
2W	▲ 0.035	▲ 0.005	▲ 0.027				-	▲ 0.174						
3W			0.010				-	▲ 0.162						
1M	▲ 0.030	0.000	▲ 0.026				-	▲ 0.155						
3M							▲ 0.398	▲ 0.150						
6M							▲ 0.340	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.317	▲ 0.228						
									日付	12/9	12/12	12/13	12/14	12/15
									日銀当預残	3,125,500	3,094,500	3,115,600	3,141,300	3,238,500
									準備預金残	2,810,800	2,795,200	2,799,100	2,816,400	2,907,900
									マネタリーベース	4,158,100	4,128,000	4,151,600	4,179,400	4,279,900
									無担O/N加重平均	▲0.050%	▲0.052%	▲0.043%	▲0.034%	▲0.029%
									コール市場残高	89,851	92,734	91,796	94,824	91,752
									うち無担	67,666	71,358	73,441	75,309	71,705
									うち有担	22,185	21,376	18,355	19,515	20,047

●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)
国庫短期証券	653	-	25,000	2016/12/20	2017/12/20	61,968.0	22,949.80	100.3010	▲0.3000%	50.8571%	100.3400	▲0.3388%	2,050.0

●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年以下)	700	2016/12/20			1,988	704	▲0.010		0.000	91.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2016/12/20			3,249	2,001	▲0.009		0.002	80.0
国債買入(残存期間25年超)	1,200	2016/12/20			4,254	1,204	▲0.012		▲0.007	7.1
社債等買入	1,250	2016/12/22			2,619	1,250	▲0.145		▲0.086	26.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	59,897	2016/12/16	2016/12/19		158	158		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	9,370	2016/12/16	2016/12/19		9	9		▲0.500	▲0.500	

●2016年12月19日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合 (1日目、20日まで)	*7-9月期の資金循環統計速報 *11月の貿易統計
----------------------------------	------------------------------

◆本資料は信頼できると思わ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