

●資金需給

単位：億円	2016年12月26日	2016年12月27日	2016年12月28日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 2,800	▲ 2,500	▲ 3,000
財政	▲ 14,100	3,300	5,000
資金過不足	▲ 16,900	800	2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	2,700	▲ 2,000	
国債買現			
国庫短期証買入		7,500	
国債買入		4,400	
CP等買入		▲ 1,100	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	
E T F 買入	100	400	
国債補完供給	▲ 100	1,100	100
当預増減	▲ 16,000	12,000	2,000
当座預金残高	3,315,100	3,327,100	3,329,100
準備預金残高	2,977,000		
積み終了先	2,483,600	12月27日以降の残リ所要積立額	
超過準備	2,483,600	積数	6,800
非準備預金先	338,100	1日平均	300
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	99.69%	日数
			35.48%

●短期金融市場関連指標

2016/12/26	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	▲ 0.100	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.094
T/N							-	▲ 0.091
S/N							-	-
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.271
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.194
3W							-	▲ 0.168
1M							-	▲ 0.153
3M							▲ 0.447	▲ 0.150
6M							▲ 0.343	▲ 0.225
1Y							▲ 0.359	▲ 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)
0.055	0.005	19,396.64	▲ 31.03	117.32-33	117.14-19

日付	12/16	12/19	12/20	12/21	12/22
日銀当預残	3,259,900	3,254,200	3,312,200	3,330,800	3,331,100
準備預金残	2,927,100	2,930,100	2,983,200	2,986,800	2,997,400
マネタリーベース	4,304,400	4,301,400	4,364,200	4,387,500	4,393,100
無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.036%	▲0.032%	▲0.027%	▲0.028%
コール市場残高	91,626	92,326	100,639	103,451	105,740
うち無担	71,328	74,379	81,190	84,850	86,585
うち有担	20,298	17,947	19,449	18,601	19,155

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	47,493	2016/12/26	2016/12/27		120	120		▲0.500	▲0.500	

●2016年12月27日の予定

*11月の完全失業率	*11月の有効求人倍率	*米国10月の S&P/ケース・シラー住宅価格指数
*11月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比+0.2%)		*米国12月のCB消費者信頼感指数
*11月全国・12月都区部消費者物価指数(CPI)		*London祝日(Christmas Day、observed)
市場予想：全 国(11月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.3%		*2年利付国債入札 (23,000億円、1/16発行)
市場予想：東京都区部(12月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%		
*11月の住宅着工統計		

◆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