

●資金需給

単位：億円	2016年12月30日	2017年1月4日	2017年1月5日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	100	5,500	6,000
財政	▲ 6,900	900	▲ 3,000
資金過不足	▲ 6,800	6,400	3,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		1,300	▲ 1,600
国債買現			
国庫短期証買入			
国債買入	4,100	12,400	
CP等買入	4,500	▲ 3,800	
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	▲ 6,100	200	6,100
当預増減	▲ 7,200	24,900	3,000
当座預金残高	3,302,400	3,327,300	3,330,300
準備預金残高	2,953,700		
積み終了先	2,462,000	1月4日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,461,700	積数	1,800
非準備預金先	348,700	1日平均	100
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額			2,202,100
準備預金進捗率	実績	99.92%	日数 61.29%

●短期金融市場関連指標

2016/12/30	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	▲ 0.058				-	▲ 0.194
T/N			0.000				-	▲ 0.090
S/N							-	-
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.100
2W	▲ 0.050	▲ 0.035	▲ 0.043				-	▲ 0.101
3W							-	▲ 0.104
1M							-	▲ 0.112
3M							▲ 0.391	▲ 0.157
6M							▲ 0.309	▲ 0.225
1Y							▲ 0.313	▲ 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)
0.041	0.001	19,114.37	▲ 30.77	116.31-34	117.10-12

日付	12/22	12/26	12/27	12/28	12/29
日銀当預残	3,331,100	3,315,100	3,326,500	3,322,800	3,309,600
準備預金残	2,997,400	2,977,000	2,995,100	2,995,800	2,986,200
マネタリーベース	4,393,100	4,379,900	4,393,900	4,392,700	4,381,700
無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.041%	▲ 0.048%	▲ 0.046%	▲ 0.048%
コール市場残高	105,740	93,804	102,313	98,652	97,138
うち無担	86,585	75,068	81,326	78,717	76,270
うち有担	19,155	18,736	20,987	19,935	20,868

●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)	173,444	2016/12/30	2017/1/4		5,949	5,949		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/12/30	2017/1/4		65	65		▲ 0.500	▲ 0.500	

●2017年1月3日の予定

米国11月の建設支出 米国12月のISM製造業景況指数

●2017年1月4日の予定

*証券取引所大発会	*ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値
-----------	---------------------

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願い申し上げます。

◆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