

●資金需給

単位：億円	2017年1月11日	2017年1月12日	2017年1月13日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	4,300	2,800	3,000
財政	▲ 13,800	▲ 9,600	▲ 11,000
資金過不足	▲ 9,500	▲ 6,800	▲ 8,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国庫短期証買入		17,500	
国債買入	5,000	8,600	
CP等買入		▲ 200	▲ 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	700		
国債補完供給	▲ 200	200	200
当預増減	▲ 4,000	21,700	▲ 8,000
当座預金残高	3,292,800	3,314,500	3,306,500
準備預金残高	2,967,200		
積み終了先	2,485,700	1月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,485,600	積数	100
非準備預金先	325,600	1日平均	0
積み期間 (12/16~1/15) の所要準備額			2,222,400
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 87.10%

●短期金融市場関連指標

2017/1/11	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	▲ 0.080	0.005	▲ 0.030				-	▲ 0.085
T/N							-	▲ 0.087
S/N							-	-
1W	▲ 0.027	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.096
2W			0.000				-	▲ 0.098
3W							-	▲ 0.101
1M							-	▲ 0.105
3M							▲ 0.347	▲ 0.154
6M							▲ 0.388	▲ 0.225
1Y							▲ 0.302	▲ 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	0.000	19,364.67	63.23	115.86-88	116.04-06

日付	12/30	1/4	1/5	1/6	1/10
日銀当預残	3,302,400	3,328,300	3,331,300	3,328,100	3,296,800
準備預金残	2,955,000	2,996,000	3,002,500	3,000,400	2,974,200
マネタリーベース	4,374,400	4,394,800	4,393,500	4,386,600	4,351,000
無担O/N加重平均	▲ 0.058%	▲ 0.051%	▲ 0.047%	▲ 0.042%	▲ 0.037%
コール市場残高	82,952	91,677	96,692	102,586	101,413
うち無担	71,150	72,944	77,073	82,019	81,164
うちO/N	-	47,804	50,313	52,659	52,544
うち有担	11,802	18,733	19,619	20,567	20,249

●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	素分率	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)
30年利付国債	53	0.60%	8,000	2017/1/13	2046/12/20	24,093.0	7,227.0	96.2000	0.7550%	36.9918%	96.4300	0.7450%	766.0
エネルギー対策	-	-	5,000	2017/1/20	2018/1/22	34,964.0	4,999.98		0.0000%	14.4197%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	22,169	2017/1/11	2017/1/12		47	47		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,758	2017/1/11	2017/1/12		116	116		▲ 0.500	▲ 0.500	

●2017年1月12日の予定

*11月の国際収支 *12月の景気ウォッチャー調査	*米国12月の財政収支	*国庫短期証券(657回)入札 (3ヶ月、44,000億円、1/16発行)
------------------------------	-------------	--

◆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