

●資金需給

単位：億円	2017年1月16日 需給速報	2017年1月17日 需給予想	2017年1月18日 当社予想
銀行券	2,500	2,000	2,000
財政	▲ 38,900	3,700	▲ 1,000
資金過不足	▲ 36,400	5,700	1,000
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		15,000	
国債買入	7,400		12,300
CP等買入		▲ 900	▲ 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			
E T F 買入	1,100		
国債補完供給	▲ 2,100	900	2,100
当預増減	▲ 29,900	22,400	13,300
当座預金残高	3,279,300	3,301,700	3,315,000
準備預金残高	2,946,900		
積み終了先	954,300	1月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	713,800	積数	473,600
非準備預金先	332,400	1日平均	15,800
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			2,229,400
準備預金進捗率	実績	78.76%	日数
			3.23%

●短期金融市場関連指標

2017/1/16	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	0.005	▲ 0.047				-	▲ 0.105	0.050	0.005	19,095.24	▲ 192.04	114.21-23	114.07-09
T/N							-	▲ 0.111						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.005	▲ 0.027				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.034				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.266	▲ 0.154						
6M							▲ 0.324	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.301	▲ 0.228						
									日付	1/6	1/10	1/11	1/12	1/13
日銀当預残									3,328,100	3,296,800	3,292,800	3,314,800	3,309,200	
準備預金残									3,000,400	2,974,200	2,969,800	2,972,400	2,973,900	
マネタリーベース									4,386,600	4,351,000	4,342,700	4,361,700	4,354,100	
無担O/N加重平均									▲ 0.042%	▲ 0.037%	▲ 0.030%	▲ 0.027%	▲ 0.026%	
コール市場残高									102,586	101,413	100,845	100,166	101,665	
									うち無担	82,019	81,164	79,913	79,533	81,685
									うちO/N	52,659	52,544	51,773	51,438	56,240
									うち有担	20,567	20,249	20,932	20,633	19,980

●入札結果

名称	回数	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2017/1/18			10,906	4,000	0.004		0.005	64.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2017/1/18			17,060	4,203	0.003		0.004	5.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2017/1/18			17,003	4,101	0.003		0.003	80.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	58,579	2017/1/16	2017/1/17		2,027	2,027		▲ 0.500	▲ 0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	8,161	2017/1/16	2017/1/17		33	33		▲ 0.500	▲ 0.500	

●2017年1月17日の予定

*11月のマネタリーサーベイ	*英国12月の消費者物価指数	*20年利付国債入札 (11,000億円、1/19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録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