

●資金需給

単位：億円	2017年1月25日 需給速報	2017年1月26日 需給予想	2017年1月27日 当社予想
銀行券	100	▲ 500	▲ 1,000
財政	6,100	▲ 2,400	▲ 2,000
資金過不足	6,200	▲ 2,900	▲ 3,000
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			
国債買入	5,000		3,300
CP等買入		▲ 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		1,000	
E T F 買入	100	500	
国債補完供給	▲ 100		100
当預増減	10,800	▲ 1,600	300
当座預金残高	3,305,100	3,303,500	3,303,800
準備預金残高	2,954,100		
積み終了先	2,474,700	1月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,474,700	積数	12,100
非準備預金先	351,000	1日平均	600
積み期間 (1/16~2/15) の所要準備額			2,229,500
準備預金進捗率	実績	99.46%	日数
			32.26%

●短期金融市場関連指標

2017/1/25	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.096
T/N							-	▲ 0.089
S/N							-	-
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.118
2W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.117
3W							-	▲ 0.118
1M							-	▲ 0.120
3M							▲ 0.309	▲ 0.152
6M							▲ 0.307	▲ 0.225
1Y							▲ 0.405	▲ 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)
0.065	0.025	19,057.50	269.51	113.85-87	113.54-55
日付	1/18	1/19	1/20	1/23	1/24
日銀当預残	3,309,300	3,298,500	3,286,000	3,271,400	3,294,300
準備預金残	2,966,600	2,954,900	2,946,200	2,951,000	2,953,500
マネタリーベース	4,348,100	4,336,600	4,323,800	4,308,600	4,331,400
無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.047%	▲ 0.046%	▲ 0.048%	▲ 0.050%
コール市場残高	97,091	97,354	100,206	98,870	98,993
うち無担	76,242	76,329	80,439	79,381	78,376
うちO/N	52,560	50,704	53,209	52,656	52,551
うち有担	20,849	21,025	19,767	19,489	20,617

●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)
交付税特会	-	-	10,500	2017/2/3	2017/8/3	127,539.0	10,500.01		0.0000%	8.2611%		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
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2017/1/27			3,897	1,902	0.018		0.025	25.4
国債買入(残存期間25年超)	1,100	2017/1/27			2,384	1,102	0.027		0.039	38.8
国債買入(物価連動債)	250	2017/1/27			911	251	▲ 0.120		▲ 0.230	7.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	27,399	2017/1/25	2017/1/26		91	91		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年1月26日の予定

*12月の企業向けサービス価格指数	*米国12月の新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(660回)入札 (3ヶ月、44,000億円、1/30発行)
	*英国10-12月期のGDP速報値	*流動性供給入札 (5,000億円、1/30発行)

◆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