

●資金需給

単位：億円	2016年12月22日	2016年12月26日	2016年12月27日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 5,300	▲ 3,100	▲ 4,000
財政	5,600	▲ 14,900	6,000
資金過不足	300	▲ 18,000	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		▲ 700	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援	100		
社債等買入	1,300	▲ 100	▲ 200
E T F 買入		100	
国債補完供給	▲ 1,100	300	1,100
当預増減	300	▲ 17,000	13,900
当座預金残高	3,331,100	3,314,100	3,328,000
準備預金残高	2,996,600		
積み終了先	2,501,200	12月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,499,000	積数	7,700
非準備預金先	334,500	1日平均	400
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	99.65%	日数
			32.26%

●短期金融市場関連指標

2016/12/22	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.094
T/N							-	▲ 0.089
S/N							-	-
1W							-	▲ 0.246
2W	▲ 0.022	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.183
3W							-	▲ 0.168
1M			0.005				-	▲ 0.153
3M							▲ 0.447	▲ 0.150
6M							▲ 0.346	▲ 0.225
1Y							▲ 0.361	▲ 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)
0.050	▲ 0.005	19,427.67	▲ 16.82	117.61-64	117.66-67

日付	12/15	12/16	12/19	12/20	12/21
日銀当預残	3,238,500	3,259,900	3,254,200	3,312,200	3,330,800
準備預金残	2,907,900	2,927,100	2,930,100	2,983,200	2,986,800
マネタリーベース	4,279,900	4,304,400	4,301,400	4,364,200	4,387,500
無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.037%	▲0.036%	▲0.032%	▲0.027%
コール市場残高	91,752	91,626	92,326	100,639	103,451
うち無担	71,705	71,328	74,379	81,190	84,850
うち有担	20,047	20,298	17,947	19,449	18,601

●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
国庫短期証券買入	7,500	2016/12/27			12,765	7,500	▲0.016		▲0.004	75.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,100	2016/12/27			14,589	4,108	▲0.007		▲0.005	8.7
国債買入(物価連動債)	250	2016/12/27			1,366	252	▲0.070		▲0.151	42.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	96,485	2016/12/22	2016/12/26		1,054	1,054		▲0.500	▲0.500	

●2016年12月23日の予定

*天皇誕生日	*米国11月の新築一戸建て販売件数	*英国7-9月期のGDP確報値
--------	-------------------	-----------------

●2016年12月26日の予定

*黒田日銀総裁、 日本経済団体連合会審議委員会にて講演 *日銀金融政策決定会合議事要旨 (10月31日、11月1日開催分)	*10月の景気動向指数改訂状況 *11月の企業向けサービス価格指数	*New York祝日(Christmas Day、observed) *EURO祝日(Christmas Holiday) *London祝日(Boxing Day)
--	--------------------------------------	--

◆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