

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成26年3月20日(木)分  
《 資金需給 》

平成26年3月24日  
[セントラル短資株式会社]

単位：億円

|                            |                                      | 予想      | 速報        | 確報        |        |
|----------------------------|--------------------------------------|---------|-----------|-----------|--------|
| 需給                         | 銀行券要因                                | -2,800  | -2,700    | -2,700    |        |
|                            | 財政等要因                                | +52,700 | +53,900   | +53,900   |        |
|                            | 資金過不足                                | +49,900 | +51,200   | +51,200   |        |
| 金融調節                       | 貸出                                   |         |           |           |        |
|                            | 本店共通                                 |         |           |           |        |
|                            | 全店共通                                 |         |           |           |        |
|                            | 共通(固定)<br>153,740                    |         |           |           |        |
|                            | 手形売出                                 |         |           |           |        |
|                            | 国債売現先                                |         |           |           |        |
|                            | 国債買現先                                |         |           |           |        |
|                            | C P 買現先                              |         |           |           |        |
|                            | 国短買入                                 |         |           |           |        |
|                            | 国庫短期証売却                              |         |           |           |        |
|                            | 国債買入                                 | +15,100 | +15,100   | +15,100   |        |
|                            | C P 等買入                              | +4,100  | +4,100    | +4,100    |        |
|                            | 社債買入                                 | -700    | -700      | -700      |        |
|                            | ETF買入                                | -300    | -300      | -300      |        |
|                            | 被災地支援<br>3,805                       |         |           |           |        |
|                            | 国債補完供給                               |         |           |           |        |
|                            | 貸出支援基金<br>(成長) 33,429<br>(増加) 85,512 |         |           |           |        |
|                            | 小計                                   | +18,200 | +18,200   | +18,200   |        |
|                            | 当預増減                                 | +68,100 | +69,400   | +69,400   |        |
|                            | 当座預金残高                               |         | 1,235,800 | 1,235,800 |        |
| 準備預金残高                     | 1,122,800                            |         | 1,122,900 |           |        |
| 積み終了先                      | 923,300                              |         | 923,400   |           |        |
| 超過準備                       | 906,600                              |         | 906,800   |           |        |
| 非準備先残高                     | 113,000                              |         | 112,900   |           |        |
| マネタリーベース                   |                                      |         | 2,143,800 |           |        |
| (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |                                      |         | 944,000   |           |        |
| 積み期間の所要準備額(積数)             |                                      |         | 確報        |           |        |
| 3/24日以降の残り要積立額(積数)         |                                      |         | 148,200   |           |        |
| 3/24日以降の残り要積立額(1日平均)       |                                      |         | 6,400     |           |        |
| 3/20日以降の残り要積立額(積数)         |                                      |         | 301,000   |           |        |
| 3/20日以降の残り要積立額(1日平均)       |                                      |         | 11,100    |           |        |
| 準備預金進捗率(%)                 |                                      | 実績      | 92.07%    | 日数        | 25.81% |

コール市場残高

| コール市場 | 残高      | 前日比    | (無担)   | (前日比) | (有担)    | (前日比)  |
|-------|---------|--------|--------|-------|---------|--------|
| 全国    | 179,582 | +5,318 | 69,412 | +25   | 110,170 | +5,293 |

コールレート実績

|    | 有担保コールレート |       |       |              |    |    |
|----|-----------|-------|-------|--------------|----|----|
|    | 当日分       |       |       | トム・スポットスタート分 |    |    |
|    | 平均        | 最低    | 最高    | 平均           | 最低 | 最高 |
| ON | 0.041     | 0.040 | 0.050 |              |    |    |
| TN |           |       |       |              |    |    |
| SN |           |       |       |              |    |    |
| 2日 |           |       |       |              |    |    |
| 3日 |           |       |       |              |    |    |
| 4日 |           |       |       |              |    |    |
| 5日 |           |       |       |              |    |    |
| 6日 |           |       |       |              |    |    |

|     | 無担保コールレート |       |       |              |       |       |
|-----|-----------|-------|-------|--------------|-------|-------|
|     | 当日スタート分   |       |       | トム・スポットスタート分 |       |       |
|     | 平均        | 最低    | 最高    | 平均           | 最低    | 最高    |
| ON  | 0.072     | 0.055 | 0.150 |              |       |       |
| TN  |           |       |       | 0.075        | 0.065 | 0.120 |
| SN  |           |       |       |              |       |       |
| 2日  |           |       |       | 0.093        |       |       |
| 3日  |           |       |       |              |       |       |
| 4日  |           |       |       |              |       |       |
| 5日  |           |       |       |              |       |       |
| 6日  |           |       |       |              |       |       |
| 1W  |           |       |       | 0.116        | 0.075 | 0.117 |
| 2W  |           |       |       |              |       |       |
| 3W  |           |       |       |              |       |       |
| 1M  |           |       |       |              |       |       |
| 2M  |           |       |       |              |       |       |
| 3M  |           |       |       |              |       |       |
| 4M  |           |       |       |              |       |       |
| 5M  |           |       |       |              |       |       |
| 6M  |           |       |       |              |       |       |
| 7M  |           |       |       |              |       |       |
| 8M  |           |       |       |              |       |       |
| 9M  |           |       |       |              |       |       |
| 10M |           |       |       |              |       |       |
| 11M |           |       |       |              |       |       |
| 1Y  |           |       |       |              |       |       |

| (参考)                         |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(3/16~4/15日)の所要準備額(積数)   | 1,870,000 |
| 積み期間(3/16~4/15日)の所要準備額(1日平均) | 60,300    |

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなさい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。