

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成26年10月21日(火)分  
《 資金需給 》

平成26年10月22日  
[セントラル短資株式会社]

単位：億円

| 需給                                   |                            | 予想      | 速報        | 確報        |
|--------------------------------------|----------------------------|---------|-----------|-----------|
|                                      | 銀行券要因                      | -500    | -600      | -600      |
|                                      | 財政等要因                      | -24,000 | -23,900   | -23,900   |
|                                      | 資金過不足                      | -24,500 | -24,500   | -24,500   |
| 金<br><br>融<br><br>調<br><br>節         | 貸出                         |         |           |           |
|                                      | 本店共通                       |         |           |           |
|                                      | -                          |         |           |           |
|                                      | 全店共通                       |         |           |           |
|                                      | -                          |         |           |           |
|                                      | 共通(固定)                     |         |           |           |
|                                      | 95,098                     |         |           |           |
|                                      | 手形売出                       |         |           |           |
|                                      | -                          |         |           |           |
|                                      | 国債売現先                      |         |           |           |
|                                      | -                          |         |           |           |
|                                      | 国債買現先                      |         |           |           |
|                                      | -                          |         |           |           |
|                                      | C P 買現先                    |         |           |           |
|                                      | -                          |         |           |           |
|                                      | 国短買入                       | +26,200 | +26,200   | +26,200   |
|                                      | 国庫短期証売却                    |         |           |           |
|                                      | 国債買入                       |         |           |           |
|                                      | C P 等買入                    |         |           |           |
| マ<br>ネ<br>タ<br>リ<br>ー<br>バ<br>ー<br>ス | 社債買入                       | +900    | +900      | +900      |
|                                      | ETF買入                      | +100    | +100      | +100      |
|                                      | 被災地支援                      |         |           |           |
|                                      | 3,689                      |         |           |           |
|                                      | 国債補完供給                     |         |           |           |
|                                      | 貸出支援基金                     |         |           |           |
|                                      | (成長) 38,608                |         |           |           |
|                                      | (増加) 159,053               |         |           |           |
|                                      | 小計                         | +27,100 | +27,100   | +27,100   |
|                                      | 当預増減                       | +2,600  | +2,600    | +2,600    |
|                                      | 当座預金残高                     |         | 1,654,600 | 1,654,600 |
|                                      | 準備預金残高                     |         | 1,522,100 | 1,522,100 |
|                                      | 積み終了先                      |         | 1,214,900 | 1,214,900 |
|                                      | 超過準備                       |         | 1,212,200 | 1,212,200 |
|                                      | 非準備先残高                     |         | 132,500   | 132,500   |
|                                      | マネタリーベース                   |         | 2,564,600 |           |
|                                      | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |         | 1,244,000 |           |
|                                      | 積み期間の所要準備額(積数)             |         | 確報        |           |
|                                      | 10/22日以降の残り要積立額(積数)        |         | 123,200   |           |
|                                      | 10/22日以降の残り要積立額(1日平均)      |         | 4,900     |           |
|                                      | 10/21日以降の残り要積立額(積数)        |         | 161,900   |           |
|                                      | 10/21日以降の残り要積立額(1日平均)      |         | 6,200     |           |
|                                      | 準備預金進捗率(%)                 | 実績      | 93.59%    | 日数        |
|                                      |                            |         |           | 19.35%    |

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   | 183,572 | +2,669 | 74,474 | +2,619 | 109,098 | +50   |

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 | 0.031     | 0.030 | 0.040 |              |    |    |
| 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  | 0.060     | 0.045 | 0.135 |              |       |       |
| TN  |           |       |       | 0.067        | 0.055 | 0.120 |
| SN  |           |       |       |              |       |       |
| 2日  | 0.050     |       |       |              |       |       |
| 3日  |           |       |       |              |       |       |
| 4日  |           |       |       |              |       |       |
| 5日  |           |       |       | 0.079        |       |       |
| 6日  |           |       |       |              |       |       |
| 1W  |           |       |       | 0.130        | 0.117 | 0.150 |
| 2W  |           |       |       | 0.131        | 0.117 | 0.330 |
| 3W  |           |       |       |              |       |       |
| 1M  |           |       |       | 0.118        |       |       |
| 2M  |           |       |       |              |       |       |
| 3M  |           |       |       |              |       |       |
| 4M  |           |       |       |              |       |       |
| 5M  |           |       |       |              |       |       |
| 6M  |           |       |       |              |       |       |
| 7M  |           |       |       |              |       |       |
| 8M  |           |       |       |              |       |       |
| 9M  |           |       |       |              |       |       |
| 10M |           |       |       |              |       |       |
| 11M |           |       |       |              |       |       |
| 1Y  |           |       |       |              |       |       |

| (参考)                           |           |
|--------------------------------|-----------|
| 積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(積数)   | 1,920,500 |
| 積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(1日平均) | 62,000    |

「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