

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成26年11月27日

[セントラル短資株式会社]

## 平成26年11月26日(水)分 《 資金需給 》

単位：億円

| 需給 |                            | 予想      | 速報        | 確報        |        |
|----|----------------------------|---------|-----------|-----------|--------|
|    |                            | 銀行券要因   | -800      | -900      | -900   |
|    | 財政等要因                      | -400    | -1,000    | -1,000    |        |
|    | 資金過不足                      | -1,200  | -1,900    | -1,900    |        |
| 金  | 貸出                         |         |           |           |        |
|    | 本店共通                       |         |           |           |        |
|    | 全店共通                       |         |           |           |        |
| 融  | 共通(固定)                     |         |           |           |        |
|    | 79,977                     |         |           |           |        |
| 調  | 手形売出                       |         |           |           |        |
|    | -                          |         |           |           |        |
| 節  | 国債売現先                      |         |           |           |        |
|    | -                          |         |           |           |        |
|    | 国債買現先                      |         |           |           |        |
|    | -                          |         |           |           |        |
|    | CP買現先                      |         |           |           |        |
|    | -                          |         |           |           |        |
|    | 国短買入                       | +25,000 | +25,000   | +25,000   |        |
|    | 国庫短期証売却                    |         |           |           |        |
|    | 国債買入                       | +8,600  | +8,600    | +8,600    |        |
|    | CP等買入                      |         |           |           |        |
|    | -200                       | -200    | -200      | -200      |        |
|    | 社債買入                       |         |           |           |        |
|    | ETF買入                      |         |           |           |        |
|    | 被災地支援                      |         |           |           |        |
|    | 3,255                      |         |           |           |        |
|    | 国債補完供給                     |         | -200      | -200      |        |
|    | 貸出支援基金                     |         |           |           |        |
|    | (成長) 38,608                |         |           |           |        |
|    | (増加) 159,053               |         |           |           |        |
|    | 小計                         | +33,400 | +33,200   | +33,200   |        |
|    | 当預増減                       | +32,200 | +31,300   | +31,300   |        |
|    | 当座預金残高                     |         | 1,688,300 | 1,688,300 |        |
|    | 準備預金残高                     |         | 1,542,500 | 1,543,600 |        |
|    | 積み終了先                      |         | 1,294,700 | 1,295,700 |        |
|    | 超過準備                       |         | 1,294,700 | 1,295,700 |        |
|    | 非準備先残高                     |         | 145,800   | 144,700   |        |
|    | マネタリーベース                   |         | 2,608,200 |           |        |
|    | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |         | 1,305,000 |           |        |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)             |         | 確報        |           |        |
|    | 11/27日以降の残り要積立額(積数)        |         | 44,700    |           |        |
|    | 11/27日以降の残り要積立額(1日平均)      |         | 2,400     |           |        |
|    | 11/26日以降の残り要積立額(積数)        |         | 49,900    |           |        |
|    | 11/26日以降の残り要積立額(1日平均)      |         | 2,500     |           |        |
|    | 準備預金進捗率(%)                 | 実績      | 97.61%    | 日数        | 36.67% |

### 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    | 200,644 | +2,052 | 83,964 | +1,559 | 116,680 | +493  |

### 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  | 0.066     | 0.050 | 0.135 |              |       |       |
| TN  |           |       |       | 0.092        | 0.073 | 0.120 |
| SN  |           |       |       |              |       |       |
| 2日  |           |       |       |              |       |       |
| 3日  |           |       |       |              |       |       |
| 4日  |           |       |       |              |       |       |
| 5日  |           |       |       | 0.092        |       |       |
| 6日  |           |       |       |              |       |       |
| 1W  |           |       |       |              |       |       |
| 2W  |           |       |       | 0.116        |       |       |
| 3W  |           |       |       |              |       |       |
| 1M  |           |       |       | 0.232        | 0.230 | 0.235 |
| 2M  |           |       |       | 0.235        |       |       |
| 3M  |           |       |       |              |       |       |
| 4M  |           |       |       |              |       |       |
| 5M  |           |       |       |              |       |       |
| 6M  |           |       |       |              |       |       |
| 7M  |           |       |       |              |       |       |
| 8M  |           |       |       |              |       |       |
| 9M  |           |       |       |              |       |       |
| 10M |           |       |       |              |       |       |
| 11M |           |       |       |              |       |       |
| 1Y  |           |       |       |              |       |       |

| (参考)                           |           |
|--------------------------------|-----------|
| 積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(積数)   | 1,872,400 |
| 積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(1日平均) | 62,400    |

「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