

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成27年8月6日

[セントラル短資株式会社]

## 平成27年8月5日(水)分 《 資金需給 》

単位：億円

| 需給 |                            | 予想     | 速報        | 確報        |        |
|----|----------------------------|--------|-----------|-----------|--------|
|    |                            | 銀行券要因  | +600      | +600      | +600   |
|    | 財政等要因                      | +3,800 | +3,900    | +3,900    |        |
|    | 資金過不足                      | +4,400 | +4,500    | +4,500    |        |
| 金  | 貸出                         |        |           |           |        |
|    | 本店共通                       |        |           |           |        |
|    | 全店共通                       |        |           |           |        |
| 融  | 共通(固定)                     |        |           |           |        |
|    | 65,649                     |        |           |           |        |
| 調  | 手形売出                       |        |           |           |        |
|    | -                          |        |           |           |        |
| 節  | 国債売現先                      |        |           |           |        |
|    | -                          |        |           |           |        |
|    | 国債買現先                      |        |           |           |        |
|    | -                          |        |           |           |        |
|    | CP買現先                      |        |           |           |        |
|    | -                          |        |           |           |        |
|    | 国短買入                       |        |           |           |        |
|    | 国庫短期証売却                    |        |           |           |        |
|    | 国債買入                       | +4,700 | +4,700    | +4,700    |        |
|    | CP等買入                      |        |           |           |        |
|    | 社債買入                       | -200   | -200      | -200      |        |
|    | ETF買入                      | -100   | -100      | -100      |        |
|    | 被災地支援                      |        |           |           |        |
|    | 3,241                      |        |           |           |        |
|    | 国債補完供給                     |        |           |           |        |
|    | 貸出支援基金                     |        |           |           |        |
|    | (成長) 48,511                |        |           |           |        |
|    | (増加) 244,836               |        |           |           |        |
|    | 小計                         | +4,400 | +4,400    | +4,400    |        |
|    | 当預増減                       | +8,800 | +8,900    | +8,900    |        |
|    | 当座預金残高                     |        | 2,243,500 | 2,243,500 |        |
|    | 準備預金残高                     |        | 2,039,900 | 2,039,900 |        |
|    | 積み終了先                      |        | 1,712,300 | 1,712,300 |        |
|    | 超過準備                       |        | 1,712,300 | 1,712,300 |        |
|    | 非準備先残高                     |        | 203,600   | 203,600   |        |
|    | マネタリーベース                   |        | 3,197,700 |           |        |
|    | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |        | 1,713,000 |           |        |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)             |        | 確報        |           |        |
|    | 8/6日以降の残り要積立額(積数)          |        | 3,700     |           |        |
|    | 8/6日以降の残り要積立額(1日平均)        |        | 400       |           |        |
|    | 8/5日以降の残り要積立額(積数)          |        | 4,300     |           |        |
|    | 8/5日以降の残り要積立額(1日平均)        |        | 400       |           |        |
|    | 準備預金進捗率(%)                 | 実績     | 99.82%    | 日数        | 67.74% |

## 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    | 205,580 | -345 | 77,631 | +478  | 127,949 | -823  |

## 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  | 0.078     | 0.060 | 0.125 |              |       |       |
| TN  |           |       |       | 0.079        | 0.069 | 0.120 |
| SN  |           |       |       |              |       |       |
| 2日  |           |       |       |              |       |       |
| 3日  |           |       |       |              |       |       |
| 4日  |           |       |       |              |       |       |
| 5日  |           |       |       |              |       |       |
| 6日  |           |       |       |              |       |       |
| 1W  |           |       |       | 0.076        | 0.052 | 0.122 |
| 2W  |           |       |       | 0.170        |       |       |
| 3W  |           |       |       |              |       |       |
| 1M  |           |       |       |              |       |       |
| 2M  |           |       |       |              |       |       |
| 3M  |           |       |       |              |       |       |
| 4M  |           |       |       |              |       |       |
| 5M  |           |       |       |              |       |       |
| 6M  |           |       |       |              |       |       |
| 7M  |           |       |       |              |       |       |
| 8M  |           |       |       |              |       |       |
| 9M  |           |       |       |              |       |       |
| 10M |           |       |       |              |       |       |
| 11M |           |       |       |              |       |       |
| 1Y  |           |       |       |              |       |       |

(参考)

|                              |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(積数)   | 2,021,100 |
| 積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(1日平均) | 65,200    |

「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。

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