

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成28年3月22日(火)分  
《 資金需給 》

平成28年3月23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   | -300      | -100      |
|    | 財政等要因                                 | +43,100 | +39,700   | +39,700   |
|    | 資金過不足                                 | +42,800 | +39,600   | +39,600   |
| 金  | 貸出                                    |         |           |           |
|    | 本店共通                                  |         |           |           |
|    | 全店共通                                  |         |           |           |
| 融  | 共通(固定)                                | +4,800  | +4,800    | +4,800    |
|    | 45,449                                | -11,200 | -11,200   | -11,200   |
| 調  | 手形売出                                  |         |           |           |
|    | 国債売現先                                 |         |           |           |
| 節  | 国債買現先                                 | +3,900  | +3,900    | +3,900    |
|    | 3,848                                 |         |           |           |
|    | CP買現先                                 |         |           |           |
|    | 国短買入                                  |         |           |           |
|    | 国庫短期証売却                               |         |           |           |
|    | 国債買入                                  |         |           |           |
|    | CP等買入                                 |         |           |           |
|    |                                       | -800    | -800      | -800      |
|    | 社債買入                                  | -300    | -300      | -300      |
|    | ETF買入                                 | +200    | +200      | +200      |
|    | 被災地支援                                 |         |           |           |
|    | 3,144                                 |         |           |           |
|    | 国債補完供給                                | +2,300  | -1,900    | -1,900    |
|    |                                       |         | +2,300    | +2,300    |
|    | 貸出支援基金<br>(成長) 63,567<br>(増加) 289,658 |         |           |           |
|    | 小計                                    | -1,100  | -3,000    | -3,000    |
|    | 当増減                                   | +41,700 | +36,600   | +36,600   |
|    | 当座預金残高                                |         | 2,655,500 | 2,655,500 |
|    | 準備預金残高                                |         | 2,411,800 | 2,412,400 |
|    | 積み終了先                                 |         | 1,943,000 | 1,943,600 |
|    | 超過準備                                  |         | 1,943,000 | 1,943,600 |
|    | 非準備先残高                                |         | 243,700   | 243,100   |
|    | マネタリーベース                              |         | 3,654,500 |           |
|    | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)            |         | 1,963,000 |           |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)                        |         | 確報        |           |
|    | 3/23日以降の残り要積立額(積数)                    |         | 58,500    |           |
|    | 3/23日以降の残り要積立額(1日平均)                  |         | 2,400     |           |
|    | 3/22日以降の残り要積立額(積数)                    |         | 71,800    |           |
|    | 3/22日以降の残り要積立額(1日平均)                  |         | 2,900     |           |
|    | 準備預金進捗率(%)                            | 実績      | 97.14%    | 日数        |
|    |                                       |         |           | 22.58%    |

## 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    | 45,450 | +4,225 | 33,205 | +4,822 | 12,245 | -597  |

## 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 | 0.001     |    |    |              |    |    |
| 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  | -0.003    | -0.040 | 0.010 |              |        |       |
| TN  |           |        |       | 0.000        |        |       |
| SN  |           |        |       |              |        |       |
| 2日  |           |        |       |              |        |       |
| 3日  |           |        |       |              |        |       |
| 4日  |           |        |       |              |        |       |
| 5日  |           |        |       |              |        |       |
| 6日  |           |        |       | 0.130        |        |       |
| 1W  |           |        |       | 0.023        | -0.001 | 0.080 |
| 2W  |           |        |       | 0.100        |        |       |
| 3W  |           |        |       |              |        |       |
| 1M  |           |        |       | 0.117        | 0.100  | 0.130 |
| 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)   | 2,047,100 |
| 積み期間(3/16~4/15日)の所要準備額(1日平均) | 66,000    |

「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