

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成28年5月18日(水)分  
《 資金需給 》

平成28年5月19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 | +600      | +700      |
|    | 財政等要因                      | +300  | +2,900    | +2,900    |
|    | 資金過不足                      | +900  | +3,600    | +3,600    |
| 金  | 貸出                         |       |           |           |
|    | 本店共通                       |       |           |           |
|    | 全店共通                       |       |           |           |
| 融  | 共通(固定)                     |       |           |           |
|    | 16,920                     |       |           |           |
| 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                       |       |           |           |
|    | CP等買入                      | -200  | -200      | -200      |
|    | 社債買入                       |       |           |           |
|    | ETF買入                      |       |           |           |
|    | 被災地支援                      |       |           |           |
|    | 4,212                      |       |           |           |
|    | 国債補完供給                     | +200  | -200      | -200      |
|    | 貸出支援基金                     |       | +200      | +200      |
|    | (成長) 63,567                |       |           |           |
|    | (増加) 289,658               |       |           |           |
|    | 小計                         | 0     | -200      | -200      |
|    | 当預増減                       | +900  | +3,400    | +3,400    |
|    | 当座預金残高                     |       | 2,822,100 | 2,822,100 |
|    | 準備預金残高                     |       | 2,552,300 | 2,552,300 |
|    | 積み終了先                      |       | 2,025,400 | 2,025,400 |
|    | 超過準備                       |       | 1,988,100 | 1,988,100 |
|    | 非準備先残高                     |       | 269,800   | 269,800   |
|    | マネタリーベース                   |       | 3,819,500 |           |
|    | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |       | 2,100,000 |           |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)             |       | 確報        |           |
|    | 5/19日以降の残り要積立額(積数)         |       | 140,300   |           |
|    | 5/19日以降の残り要積立額(1日平均)       |       | 5,000     |           |
|    | 5/18日以降の残り要積立額(積数)         |       | 251,000   |           |
|    | 5/18日以降の残り要積立額(1日平均)       |       | 8,700     |           |
|    | 準備預金進捗率(%)                 | 実績    | 93.42%    | 日数        |
|    |                            |       |           | 9.68%     |

## 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    | 59,954 | -239 | 43,059 | -2,397 | 16,895 | +2,158 |

## 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 |           |    |    |              |    |    |
| 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  | -0.059    | -0.086 | -0.010 |              |        |        |
| TN  |           |        |        | -0.058       | -0.060 | -0.015 |
| SN  |           |        |        |              |        |        |
| 2日  |           |        |        |              |        |        |
| 3日  |           |        |        |              |        |        |
| 4日  |           |        |        |              |        |        |
| 5日  |           |        |        |              |        |        |
| 6日  |           |        |        |              |        |        |
| 1W  | -0.043    | -0.050 | -0.020 | -0.050       |        |        |
| 2W  | 0.000     |        |        |              |        |        |
| 3W  |           |        |        |              |        |        |
| 1M  |           |        |        |              |        |        |
| 2M  |           |        |        |              |        |        |
| 3M  |           |        |        |              |        |        |
| 4M  |           |        |        |              |        |        |
| 5M  |           |        |        |              |        |        |
| 6M  |           |        |        |              |        |        |
| 7M  |           |        |        |              |        |        |
| 8M  |           |        |        |              |        |        |
| 9M  |           |        |        |              |        |        |
| 10M |           |        |        |              |        |        |
| 11M |           |        |        |              |        |        |
| 1Y  |           |        |        |              |        |        |

| (参考)                         |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(5/16~6/15日)の所要準備額(積数)   | 2,132,500 |
| 積み期間(5/16~6/15日)の所要準備額(1日平均) | 68,800    |

「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