

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成28年8月4日

[セントラル短資株式会社]

平成28年8月3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      |
|    | 財政等要因                      | -46,700 | -46,700   | -46,700   |
|    | 資金過不足                      | -46,100 | -46,100   | -46,100   |
| 金  | 貸出                         |         |           |           |
|    | 本店共通                       |         |           |           |
|    | 全店共通                       |         |           |           |
| 融  | 共通(固定)                     |         |           |           |
|    | 10,250                     |         |           |           |
| 調  | 手形売出                       |         |           |           |
|    | -                          |         |           |           |
| 節  | 国債売現先                      |         |           |           |
|    | -                          |         |           |           |
|    | 国債買現先                      |         |           |           |
|    | -                          |         |           |           |
|    | CP買現先                      |         |           |           |
|    | -                          |         |           |           |
|    | 国短買入                       | +12,500 | +12,500   | +12,500   |
|    | 国庫短期証売却                    |         |           |           |
|    | 国債買入                       | +9,000  | +9,000    | +9,000    |
|    | CP等買入                      |         |           |           |
|    | 社債買入                       | -100    | -100      | -100      |
|    | ETF買入                      |         |           |           |
|    | 被災地支援等                     |         |           |           |
|    | 4,581                      |         |           |           |
|    | 国債補完供給                     | +300    | -500      | -500      |
|    | 貸出支援基金                     |         |           |           |
|    | (成長) 68,139                |         |           |           |
|    | (増加) 328,557               |         |           |           |
|    | 小計                         | +21,600 | +21,100   | +21,100   |
|    | 当預増減                       | -24,500 | -25,000   | -25,000   |
|    | 当座預金残高                     |         | 2,971,200 | 2,971,200 |
|    | 準備預金残高                     |         | 2,671,900 | 2,671,900 |
|    | 積み終了先                      |         | 2,214,500 | 2,214,500 |
|    | 超過準備                       |         | 2,214,500 | 2,214,500 |
|    | 非準備先残高                     |         | 299,300   | 299,300   |
|    | マネタリーベース                   |         | 3,980,500 |           |
|    | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |         | 2,218,000 |           |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)             |         | 確報        |           |
|    | 8/4日以降の残所要積立額(積数)          |         | 4,800     |           |
|    | 8/4日以降の残所要積立額(1日平均)        |         | 400       |           |
|    | 8/3日以降の残所要積立額(積数)          |         | 5,200     |           |
|    | 8/3日以降の残所要積立額(1日平均)        |         | 400       |           |
|    | 準備預金進捗率(%)                 | 実績      | 99.78%    | 日数        |
|    |                            |         |           | 61.29%    |

## 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    | 79,622 | +522 | 60,698 | +1,169 | 18,924 | -647  |

## 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  | -0.041    | -0.070 | 0.001 |              |        |       |
| TN  |           |        |       | -0.010       |        |       |
| SN  |           |        |       |              |        |       |
| 2日  | -0.035    |        |       |              |        |       |
| 3日  |           |        |       |              |        |       |
| 4日  |           |        |       |              |        |       |
| 5日  |           |        |       |              |        |       |
| 6日  |           |        |       |              |        |       |
| 1W  | -0.020    |        |       | -0.007       | -0.025 | 0.010 |
| 2W  |           |        |       | -0.020       |        |       |
| 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)   | 2,139,400 |
| 積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(1日平均) | 69,000    |

「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