

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成28年9月14日(水)分  
《 資金需給 》

平成28年9月15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                                 | -200   | -300      | -300                 |
|                              | 財政等要因                                 | -4,300 | -4,100    | -4,100               |
|                              | 資金過不足                                 | -4,500 | -4,400    | -4,400               |
| 金<br><br>融<br><br>調<br><br>節 | 貸出                                    |        |           |                      |
|                              | 本店共通                                  |        |           |                      |
|                              | -                                     |        |           |                      |
|                              | 全店共通                                  |        |           |                      |
|                              | -                                     |        |           |                      |
|                              | 共通(固定)                                |        |           |                      |
|                              | 4,010                                 |        |           |                      |
|                              | 手形売出                                  |        |           |                      |
|                              | -                                     |        |           |                      |
|                              | 国債売現先                                 |        |           |                      |
|                              | -                                     |        |           |                      |
|                              | 国債買現先                                 |        |           |                      |
|                              | -                                     |        |           |                      |
|                              | C P 買現先                               |        |           |                      |
|                              | -                                     |        |           |                      |
|                              | 国短買入                                  |        |           |                      |
|                              | 国庫短期証売却                               |        |           |                      |
|                              | 国債買入                                  | +4,700 | +4,700    | +4,700               |
|                              | C P 等買入                               |        |           |                      |
|                              |                                       | -300   | -300      | -300                 |
|                              | 社債買入                                  | -100   | -100      | -100                 |
|                              | ETF買入                                 |        |           |                      |
|                              | 被災地支援等                                |        |           |                      |
|                              | 5,045                                 |        |           |                      |
|                              | 国債補完供給                                |        | -3,600    | -3,600               |
|                              |                                       | +200   | +200      | +200                 |
|                              | 貸出支援基金<br>(成長) 71,647<br>(増加) 328,557 |        |           |                      |
|                              | 小計                                    | +4,500 | +900      | +900                 |
|                              | 当預増減                                  | 0      | -3,500    | -3,500               |
|                              | 当座預金残高                                |        | 3,036,900 | 3,036,900            |
|                              | 準備預金残高                                |        | 2,725,600 | 2,725,600            |
|                              | 積み終了先                                 |        | 2,273,100 | 2,273,100            |
|                              | 超過準備                                  |        | 2,273,100 | 2,273,100            |
|                              | 非準備先残高                                |        | 311,300   | 311,300              |
| マネタリーベース                     |                                       |        |           | 4,042,500            |
| (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)   |                                       |        |           | 2,272,000            |
| 積み期間の所要準備額(積数)               |                                       |        |           | 確報                   |
| 9/15日以降の残りに要積立額(積数)          |                                       |        |           | 0                    |
| 9/15日以降の残りに要積立額(1日平均)        |                                       |        |           | 0                    |
| 9/14日以降の残りに要積立額(積数)          |                                       |        |           | 0                    |
| 9/14日以降の残りに要積立額(1日平均)        |                                       |        |           | 0                    |
| 準備預金進捗率(%)                   |                                       |        |           | 実績 100.00% 日数 96.77% |

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   | 77,674 | +850 | 57,337 | -174  | 20,337 | +1,024 |

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  | -0.063    | -0.085 | 0.001 |              |        |       |
| TN  |           |        |       | -0.066       | -0.070 | 0.000 |
| SN  |           |        |       |              |        |       |
| 2日  |           |        |       |              |        |       |
| 3日  |           |        |       |              |        |       |
| 4日  |           |        |       |              |        |       |
| 5日  |           |        |       |              |        |       |
| 6日  |           |        |       |              |        |       |
| 1W  |           |        |       | -0.017       | -0.040 | 0.230 |
| 2W  |           |        |       | -0.019       | -0.040 | 0.002 |
| 3W  |           |        |       | 0.040        |        |       |
| 1M  |           |        |       |              |        |       |
| 2M  |           |        |       |              |        |       |
| 3M  |           |        |       |              |        |       |
| 4M  |           |        |       |              |        |       |
| 5M  |           |        |       |              |        |       |
| 6M  |           |        |       |              |        |       |
| 7M  |           |        |       |              |        |       |
| 8M  |           |        |       |              |        |       |
| 9M  |           |        |       |              |        |       |
| 10M |           |        |       |              |        |       |
| 11M |           |        |       |              |        |       |
| 1Y  |           |        |       |              |        |       |

| (参考)                         |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(積数)   | 2,149,000 |
| 積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(1日平均) | 69,300    |

「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