

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成28年10月6日

[セントラル短資株式会社]

平成28年10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                                 |        | -100      | 0         |
| 財政等要因 |                                       | +400   | +1,100    | +1,100    |
| 資金過不足 |                                       | +300   | +1,100    | +1,100    |
| 金     | 貸出                                    |        |           |           |
|       | 本店共通                                  |        |           |           |
| 融     | 全店共通                                  |        |           |           |
|       | 共通(固定)<br>4,690                       |        |           |           |
| 調     | 手形売出                                  |        |           |           |
|       | 国債売現先                                 |        |           |           |
| 節     | 国債買現先                                 |        |           |           |
|       | CP買現先                                 |        |           |           |
|       | 国短買入                                  |        |           |           |
|       | 国庫短期証売却                               |        |           |           |
|       | 国債買入                                  | +9,100 | +9,100    | +9,100    |
|       | CP等買入                                 |        |           |           |
|       | 社債買入                                  | -300   | -300      | -300      |
|       | ETF買入                                 |        |           |           |
|       | 被災地支援等<br>4,880                       |        |           |           |
|       | 国債補完供給                                | +100   | -100      | -100      |
|       | 貸出支援基金<br>(成長) 71,647<br>(増加) 374,549 |        | +100      | +100      |
|       | 小計                                    | +8,900 | +8,800    | +8,800    |
|       | 当預増減                                  | +9,200 | +9,900    | +9,900    |
|       | 当座預金残高                                |        | 3,098,200 | 3,098,200 |
|       | 準備預金残高                                |        | 2,779,200 | 2,779,200 |
|       | 積み終了先                                 |        | 2,308,800 | 2,308,800 |
|       | 超過準備                                  |        | 2,308,800 | 2,308,800 |
|       | 非準備先残高                                |        | 319,000   | 319,000   |
|       | マネタリーベース                              |        | 4,106,400 |           |
|       | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)            |        | 2,325,000 |           |
|       | 積み期間の所要準備額(積数)                        |        | 確報        |           |
|       | 10/6日以降の残り要積立額(積数)                    |        | 3,100     |           |
|       | 10/6日以降の残り要積立額(1日平均)                  |        | 300       |           |
|       | 10/5日以降の残り要積立額(積数)                    |        | 3,900     |           |
|       | 10/5日以降の残り要積立額(1日平均)                  |        | 400       |           |
|       | 準備預金進捗率(%)                            | 実績     | 99.85%    | 日数        |
|       |                                       |        |           | 66.67%    |

## 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    | 89,903 | +4,067 | 69,319 | +4,077 | 20,584 | -10   |

## 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  | -0.030    | -0.070 | 0.001  |              |        |       |
| TN  |           |        |        |              |        |       |
| SN  |           |        |        |              |        |       |
| 2日  |           |        |        |              |        |       |
| 3日  |           |        |        |              |        |       |
| 4日  |           |        |        |              |        |       |
| 5日  |           |        |        |              |        |       |
| 6日  |           |        |        |              |        |       |
| 1W  | -0.026    | -0.030 | -0.015 | -0.021       | -0.030 | 0.000 |
| 2W  |           |        |        |              |        |       |
| 3W  |           |        |        |              |        |       |
| 1M  |           |        |        | -0.001       |        |       |
| 2M  |           |        |        |              |        |       |
| 3M  |           |        |        |              |        |       |
| 4M  |           |        |        |              |        |       |
| 5M  |           |        |        |              |        |       |
| 6M  |           |        |        |              |        |       |
| 7M  |           |        |        |              |        |       |
| 8M  |           |        |        |              |        |       |
| 9M  |           |        |        |              |        |       |
| 10M |           |        |        |              |        |       |
| 11M |           |        |        |              |        |       |
| 1Y  |           |        |        |              |        |       |

| (参考)                          |           |
|-------------------------------|-----------|
| 積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(積数)   | 2,075,500 |
| 積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(1日平均) | 69,200    |

「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