

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成29年10月20日

[セントラル短資株式会社]

平成29年10月19日(木)分

《 資金需給 》

単位：億円

| 需給 |                                       | 予想     | 速報        | 確報        |
|----|---------------------------------------|--------|-----------|-----------|
|    |                                       | 銀行券要因  | -1,000    | -1,000    |
|    | 財政等要因                                 | -8,700 | -8,400    | -8,400    |
|    | 資金過不足                                 | -9,700 | -9,400    | -9,400    |
| 金  | 貸出                                    |        |           |           |
|    | 本店共通                                  |        |           |           |
|    | 全店共通                                  |        |           |           |
| 融  | 共通(固定)                                |        |           |           |
|    | 3,725                                 | -100   | -100      | -100      |
| 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                                 | -100   | -100      | -100      |
|    | 社債買入                                  |        |           |           |
|    | ETF買入                                 |        |           |           |
|    | 被災地支援等                                |        |           |           |
|    | 5,235                                 |        |           |           |
|    | 国債補完供給                                | +400   | +400      | +400      |
|    | 貸出支援基金<br>(成長) 92,686<br>(増加) 529,457 |        |           |           |
|    | 小計                                    | +200   | -200      | -200      |
|    | 当預増減                                  | -9,500 | -9,600    | -9,600    |
|    | 当座預金残高                                |        | 3,708,400 | 3,708,400 |
|    | 準備預金残高                                |        | 3,271,300 | 3,271,300 |
|    | 積み終了先                                 |        | 3,252,900 | 3,252,900 |
|    | 超過準備                                  |        | 3,244,800 | 3,244,800 |
|    | 非準備先残高                                |        | 437,100   | 437,100   |
|    | マネタリーベース                              |        | 4,763,600 |           |
|    | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)            |        | 3,266,000 |           |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)                        |        | 確報        |           |
|    | 10/20日以降の残り要積立額(積数)                   |        | 35,700    |           |
|    | 10/20日以降の残り要積立額(1日平均)                 |        | 1,300     |           |
|    | 10/19日以降の残り要積立額(積数)                   |        | 62,100    |           |
|    | 10/19日以降の残り要積立額(1日平均)                 |        | 2,200     |           |
|    | 準備預金進捗率(%)                            | 実績     | 98.82%    | 日数        |
|    |                                       |        |           | 12.90%    |

## 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    | 93,215 | +6,659 | 71,860  | +2,446 | 21,355 | +4,213 |
|       |        |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |        |
|       |        |        | 44,895  | +1,011 |        |        |

## 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  | -0.042    | -0.065 | 0.050  |              |        |        |
| TN  |           |        |        |              |        |        |
| SN  |           |        |        |              |        |        |
| 2日  |           |        |        |              |        |        |
| 3日  |           |        |        |              |        |        |
| 4日  | -0.047    | -0.050 | -0.040 |              |        |        |
| 5日  |           |        |        |              |        |        |
| 6日  |           |        |        |              |        |        |
| 1W  | -0.046    | -0.050 | -0.038 | -0.042       | -0.045 | -0.028 |
| 2W  | -0.040    |        |        | -0.040       |        |        |
| 3W  |           |        |        |              |        |        |
| 1M  |           |        |        |              |        |        |
| 2M  |           |        |        | -0.030       |        |        |
| 3M  |           |        |        |              |        |        |
| 4M  |           |        |        |              |        |        |
| 5M  |           |        |        |              |        |        |
| 6M  |           |        |        |              |        |        |
| 7M  |           |        |        |              |        |        |
| 8M  |           |        |        |              |        |        |
| 9M  |           |        |        |              |        |        |
| 10M |           |        |        |              |        |        |
| 11M |           |        |        |              |        |        |
| 1Y  |           |        |        |              |        |        |

| (参考)                           |           |
|--------------------------------|-----------|
| 積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(積数)   | 3,019,500 |
| 積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(1日平均) | 97,400    |

「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