

≪CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)≫

2018年1月12日

[セントラル短資株式会社]

2018年1月11日(木)分

《 資金需給 》

単位：億円

需給		予想	速報	確報
銀行券要因		+2,700	+2,800	+2,800
財政等要因		+2,100	+2,000	+2,000
資金過不足		+4,800	+4,800	+4,800
金	貸出			
	本店共通			
	全店共通			
融	共通(固定)			
	5,372			
	手形売出			
	-			
調	国債売現先			
	-			
	国債買現先			
	-			
節	C P 買現先			
	-			
	国短買入	+10,000	+10,000	+10,000
	国庫短期証売却			
	国債買入	+3,000	+3,000	+3,000
	C P 等買入			
	-100	-100	-100	-100
	社債買入			
	ETF買入	+700	+700	+700
	被災地支援等			
	5,083			
	国債補完供給		-1,600	-1,600
	+400	+400	+400	+400
	貸出支援基金 (成長) 98,295 (増加) 552,528			
	小計	+14,000	+12,400	+12,400
	当預増減	+18,800	+17,200	+17,200
当座預金残高			3,711,800	3,711,800
準備預金残高			3,314,800	3,314,800
積み終了先			3,314,600	3,314,600
超過準備			3,314,600	3,314,600
非準備先残高			397,000	397,000
マネタリーベース				4,805,600
(参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)				3,316,000
積み期間の所要準備額(積数)				確報
1/12日以降の残りに要積立額(積数)				600
1/12日以降の残りに要積立額(1日平均)				100
1/11日以降の残りに要積立額(積数)				800
1/11日以降の残りに要積立額(1日平均)				200
準備預金進捗率(%)	実績	99.98%	日数	87.10%

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	102,523	-4,730	78,694	-5,090	23,829	+360
			(うち0/N)	(前日比)		
			49,739	-4,340		

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	-0.050	0.001			
TN				-0.029	-0.035	0.000
SN						
2日						
3日						
4日	-0.035					
5日	-0.033	-0.040	-0.015			
6日						
1W						
2W				0.013	0.000	0.020
3W				-0.015		
1M						
2M						
3M						
4M						
5M						
6M						
7M						
8M						
9M						
10M						
11M						
1Y						

(参考)

積み期間(12/16~1/15日)の所要準備額(積数)	3,061,100
積み期間(12/16~1/15日)の所要準備額(1日平均)	98,700

「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