

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年4月27日

[セントラル短資株式会社]

## 2020年4月24日(金)分 《 資金需給 》

単位：億円

| 需給                   | 予想                            |             | 速報          |             | 確報          |             |
|----------------------|-------------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|                      | 銀行券要因                         | -1,800      | -1,800      | -1,800      | -1,800      | -1,800      |
| 財政等要因                | +13,300                       | +13,300     | +13,600     | +13,600     | +13,600     | +13,600     |
| 資金過不足                | +11,500                       | +11,500     | +11,800     | +11,800     | +11,800     | +11,800     |
| 金                    | 貸出                            |             |             |             |             |             |
|                      | 本店共通                          |             |             |             |             |             |
| 融                    | 全店共通                          |             |             |             |             |             |
|                      | 共通(固定)                        |             |             |             |             |             |
| 調                    | 14,570                        |             |             |             |             |             |
|                      | 手形売出                          |             |             |             |             |             |
| 節                    | 国債売現先(含米ドル)                   | +900        | +900        | +900        | +900        | +900        |
|                      | -179,414                      | (うち米ドル)+900 | (うち米ドル)+900 | (うち米ドル)+900 | (うち米ドル)+900 | (うち米ドル)+900 |
| 調                    | 国債買現先                         |             |             |             |             |             |
|                      | -                             |             |             |             |             |             |
| 節                    | CP買現先                         |             |             |             |             |             |
|                      | -                             |             |             |             |             |             |
| 調                    | 国短買入                          |             |             |             |             |             |
|                      | 国庫短期証券売却                      |             |             |             |             |             |
| 節                    | 国債買入                          |             |             |             |             |             |
|                      | CP等買入                         |             |             |             |             |             |
| 調                    | 社債買入                          | -400        | -400        | -400        | -400        | -400        |
|                      | ETF買入                         | +1,100      | +1,100      | +1,100      | +1,100      | +1,100      |
| 節                    | 被災地支援等                        |             |             |             |             |             |
|                      | 5,445                         |             |             |             |             |             |
| 調                    | 新型コロナ支援                       |             |             |             |             |             |
|                      | 39,596                        |             |             |             |             |             |
| 節                    | 国債補完供給                        | +100        | +100        | -500        | -500        | -500        |
|                      | 貸出支援基金(成長) 78,310(増加) 532,345 |             |             | +100        | +100        | +100        |
| 小計                   | +1,700                        | +1,200      | +1,200      | +1,200      | +1,200      | +1,200      |
| 当預増減                 | +13,200                       | +13,000     | +13,000     | +13,000     | +13,000     | +13,000     |
| 当座預金残高               | 4,110,400                     | 4,110,200   | 4,110,200   | 4,110,200   | 4,110,200   | 4,110,200   |
| 準備預金残高               |                               | 3,552,700   | 3,552,700   | 3,552,700   | 3,552,700   | 3,552,700   |
| 積み終了先超過準備            |                               | 3,551,000   | 3,551,000   | 3,551,000   | 3,551,000   | 3,551,000   |
| 非準備先残高               |                               | 3,550,900   | 3,550,900   | 3,550,900   | 3,550,900   | 3,550,900   |
|                      |                               | 557,500     | 557,500     | 557,500     | 557,500     | 557,500     |
| マネタリーベース             |                               |             | 5,270,900   | 5,270,900   | 5,270,900   | 5,270,900   |
| 積み期間の所要準備額(積数)       |                               |             | 確報          | 確報          | 確報          | 確報          |
| 4/27日以降の残り要積立額(積数)   |                               |             | 9,200       | 9,200       | 9,200       | 9,200       |
| 4/27日以降の残り要積立額(1日平均) |                               |             | 500         | 500         | 500         | 500         |
| 4/24日以降の残り要積立額(積数)   |                               |             | 14,600      | 14,600      | 14,600      | 14,600      |
| 4/24日以降の残り要積立額(1日平均) |                               |             | 700         | 700         | 700         | 700         |
| 準備預金進捗率(%)           | 実績                            | 99.71%      | 日数          | 36.67%      |             |             |

### 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    | 121,854 | -2,846 | 106,740 | -1,943 | 15,114 | -903  |
|       |         |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |       |
|       |         |        | 68,812  | -1,883 |        |       |

### 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  | -0.047    | -0.087 | 0.001 |              |    |    |
| TN  |           |        |       |              |    |    |
| SN  |           |        |       |              |    |    |
| 2日  |           |        |       |              |    |    |
| 3日  |           |        |       | -0.001       |    |    |
| 4日  |           |        |       |              |    |    |
| 5日  |           |        |       |              |    |    |
| 6日  |           |        |       |              |    |    |
| 1W  | -0.035    |        |       |              |    |    |
| 2W  | -0.015    |        |       |              |    |    |
| 3W  |           |        |       |              |    |    |
| 1M  |           |        |       |              |    |    |
| 2M  |           |        |       |              |    |    |
| 3M  |           |        |       |              |    |    |
| 4M  |           |        |       |              |    |    |
| 5M  |           |        |       |              |    |    |
| 6M  |           |        |       |              |    |    |
| 7M  |           |        |       |              |    |    |
| 8M  |           |        |       |              |    |    |
| 9M  |           |        |       |              |    |    |
| 10M |           |        |       |              |    |    |
| 11M |           |        |       |              |    |    |
| 1Y  |           |        |       |              |    |    |

| (参考)                         |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(4/16~5/15日)の所要準備額(積数)   | 3,209,400 |
| 積み期間(4/16~5/15日)の所要準備額(1日平均) | 107,000   |

「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