

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年9月3日

[セントラル短資株式会社]

2020年9月2日(水)分  
《 資金需給 》

単位：億円

| 需給 | 予想                  |           | 速報        |           | 確報        |           |
|----|---------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|    | 銀行券要因               | 財政等要因     | 資金過不足     | 銀行券要因     | 財政等要因     | 資金過不足     |
|    | -100                | -43,700   | -43,800   | -100      | -43,700   | -43,800   |
|    |                     |           |           |           |           |           |
| 金  | 貸出                  |           |           |           |           |           |
|    | 本店共通                |           |           |           |           |           |
|    | -                   |           |           |           |           |           |
|    | 全店共通                |           |           |           |           |           |
|    | -                   |           |           |           |           |           |
| 融  | 共通(固定)              |           |           |           |           |           |
|    | 2,802               |           |           |           |           |           |
|    | 手形売出                |           |           |           |           |           |
|    | -                   |           |           |           |           |           |
| 調  | 国債売現先(含 米ドル)        |           |           |           |           |           |
|    | -30,264             |           |           |           |           |           |
|    | 国債買現先               |           |           |           |           |           |
|    | -                   |           |           |           |           |           |
| 節  | C P買現先              |           |           |           |           |           |
|    | -                   |           |           |           |           |           |
|    | 国短買入                | +20,000   | +20,000   | +20,000   | +20,000   | +20,000   |
|    | 国庫短期証券売却            |           |           |           |           |           |
|    | 国債買入                |           |           |           |           |           |
|    | C P等買入              |           |           |           |           |           |
|    | 社債買入                | -200      | -200      | -200      | -200      | -200      |
|    | ETF買入               | -100      | -100      | -100      | -100      | -100      |
|    | 被災地支援               |           |           |           |           |           |
|    | 5,177               |           |           |           |           |           |
|    | 新型コロナ支援             |           |           |           |           |           |
|    | 350,169             |           |           |           |           |           |
|    | 国債補完供給              |           | -100      | -100      | -100      | -100      |
|    |                     | +100      | +100      | +100      | +100      | +100      |
|    | 貸出支援基金              | +1,800    | +1,800    | +1,800    | +1,800    | +1,800    |
|    | (成長) 71,493         |           |           |           |           |           |
|    | (増加) 533,496        | -3,000    | -3,000    | -3,000    | -3,000    | -3,000    |
|    | 小計                  | +18,600   | +18,500   | +18,500   | +18,500   | +18,500   |
|    | 当預増減                | -25,200   | -25,300   | -25,300   | -25,300   | -25,300   |
|    | 当座預金残高              | 4,593,700 | 4,593,600 | 4,593,600 | 4,593,600 | 4,593,600 |
|    | 準備預金残高              |           | 3,999,500 | 3,999,500 | 3,999,500 | 3,999,500 |
|    | 積み終了先               |           | 3,999,500 | 3,999,500 | 3,999,500 | 3,999,500 |
|    | 超過準備                |           | 3,999,500 | 3,999,500 | 3,999,500 | 3,999,500 |
|    | 非準備先残高              |           | 594,100   | 594,100   | 594,100   | 594,100   |
|    | マネタリーベース            |           | 5,779,500 | 5,779,500 | 5,779,500 | 5,779,500 |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)      |           |           |           |           | 確報        |
|    | 9/3日以降の残り要積立額(積数)   |           |           |           |           | 500       |
|    | 9/3日以降の残り要積立額(1日平均) |           |           |           |           | 0         |
|    | 9/2日以降の残り要積立額(積数)   |           |           |           |           | 600       |
|    | 9/2日以降の残り要積立額(1日平均) |           |           |           |           | 0         |
|    | 準備預金進捗率(%)          | 実績        | 99.99%    | 日数        | 58.06%    |           |

## 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    | 118,395 | +5,976 | 96,601  | +5,219 | 21,794 | +757  |
|       |         |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |       |
|       |         |        | 63,828  | +3,619 |        |       |

## 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  | -0.051    | -0.087 | 0.001  |              |        |        |
| TN  |           |        |        | -0.001       |        |        |
| SN  |           |        |        |              |        |        |
| 2日  |           |        |        |              |        |        |
| 3日  |           |        |        |              |        |        |
| 4日  |           |        |        |              |        |        |
| 5日  |           |        |        |              |        |        |
| 6日  |           |        |        |              |        |        |
| 1W  | -0.034    | -0.035 | -0.030 | -0.028       | -0.040 | -0.020 |
| 2W  | -0.028    |        |        | -0.015       |        |        |
| 3W  |           |        |        |              |        |        |
| 1M  |           |        |        | 0.010        |        |        |
| 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)   | 3,499,200 |
| 積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(1日平均) | 112,900   |

「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