

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年9月4日

[セントラル短資株式会社]

2020年9月3日(木)分  
《 資金需給 》

単位：億円

|                                       |              | 予想        | 速報        | 確報     |
|---------------------------------------|--------------|-----------|-----------|--------|
| 需給                                    | 銀行券要因        | +100      | +100      | +100   |
|                                       | 財政等要因        | -8,000    | -7,600    | -7,600 |
|                                       | 資金過不足        | -7,900    | -7,500    | -7,500 |
| 金<br>融<br>調<br>節                      | 貸出           |           |           |        |
|                                       | 本店共通         |           |           |        |
|                                       | 全店共通         |           |           |        |
|                                       | 共通(固定)       |           |           |        |
|                                       | 2,802        |           |           |        |
|                                       | 手形売出         |           |           |        |
|                                       | -            |           |           |        |
|                                       | 国債売現先(含 米ドル) |           |           |        |
|                                       | -30,264      |           |           |        |
|                                       | 国債買現先        |           |           |        |
|                                       | -            |           |           |        |
|                                       | C P買現先       |           |           |        |
|                                       | -            |           |           |        |
|                                       | 国短買入         |           |           |        |
|                                       | 国庫短期証売却      |           |           |        |
|                                       | 国債買入         | +9,100    | +9,100    | +9,100 |
|                                       | C P等買入       |           |           |        |
| -400                                  | -400         | -400      | -400      |        |
| 社債買入                                  | -100         | -100      | -100      |        |
| ETF買入                                 | +300         | +300      | +300      |        |
| 被災地支援                                 |              |           |           |        |
| 5,177                                 |              |           |           |        |
| 新型コロナ支援                               |              |           |           |        |
| 350,169                               |              |           |           |        |
| 国債補完供給                                | +100         | -200      | -200      |        |
| 貸出支援基金<br>(成長) 71,493<br>(増加) 533,496 |              | +100      | +100      |        |
| 小計                                    | +9,000       | +8,800    | +8,800    |        |
| 当預増減                                  | +1,100       | +1,300    | +1,300    |        |
| 当座預金残高                                | 4,594,700    | 4,594,900 | 4,594,900 |        |
| 準備預金残高                                |              | 3,973,800 | 3,973,400 |        |
| 積み終了先                                 |              | 3,973,700 | 3,973,400 |        |
| 超過準備                                  |              | 3,973,700 | 3,973,400 |        |
| 非準備先残高                                |              | 621,100   | 621,500   |        |
| マネタリーベース                              |              |           | 5,780,800 |        |
| 積み期間の所要準備額(積数)                        |              | 確報        |           |        |
| 9/4日以降の残り要積立額(積数)                     |              | 500       |           |        |
| 9/4日以降の残り要積立額(1日平均)                   |              | 0         |           |        |
| 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         |           |        |
| 準備預金進捗率(%)                            | 実績           | 99.99%    | 日数        | 61.29% |

## 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    | 126,722 | +8,327 | 105,955 | +9,354 | 20,767 | -1,027 |
|       |         |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |        |
|       |         |        | 70,987  | +7,159 |        |        |

## 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  | -0.058    | -0.087 | 0.001  |              |        |       |
| TN  |           |        |        | -0.001       |        |       |
| SN  |           |        |        |              |        |       |
| 2日  |           |        |        |              |        |       |
| 3日  |           |        |        |              |        |       |
| 4日  |           |        |        |              |        |       |
| 5日  |           |        |        |              |        |       |
| 6日  |           |        |        |              |        |       |
| 1W  | -0.035    | -0.045 | -0.020 | -0.045       |        |       |
| 2W  |           |        |        | -0.003       | -0.030 | 0.030 |
| 3W  |           |        |        | 0.020        |        |       |
| 1M  |           |        |        |              |        |       |
| 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