

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年10月1日

[セントラル短資株式会社]

2020年9月30日(水)分  
《 資金需給 》

単位：億円

| 需給                   | 予想           |           | 速報        |           | 確報        |           |
|----------------------|--------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|                      | 銀行券要因        | -300      | -300      | -300      | -300      | -300      |
| 財政等要因                | -1,200       | -1,100    | -1,100    | -1,100    | -1,100    | -1,100    |
| 資金過不足                | -1,500       | -1,400    | -1,400    | -1,400    | -1,400    | -1,400    |
| 金                    | 貸出           |           |           |           |           |           |
|                      | 本店共通         |           |           |           |           |           |
| 融                    | 全店共通         |           |           |           |           |           |
|                      | 共通(固定)       |           |           |           |           |           |
| 調                    | 3,801        |           |           |           |           |           |
|                      | 手形売出         |           |           |           |           |           |
| 節                    | 国債売現先(含 米ドル) |           |           |           |           |           |
|                      | -3,722       |           |           |           |           |           |
| 調                    | 国債買現先        |           |           |           |           |           |
|                      | -            |           |           |           |           |           |
| 節                    | CP買現先        |           |           |           |           |           |
|                      | -            |           |           |           |           |           |
| 調                    | 国短買入         | +10,000   | +10,000   | +10,000   | +10,000   | +10,000   |
|                      | 国庫短期証券売却     |           |           |           |           |           |
| 節                    | 国債買入         |           |           |           |           |           |
|                      | CP等買入        |           |           |           |           |           |
| 調                    | 社債買入         |           |           |           |           |           |
|                      | ETF買入        |           |           |           |           |           |
| 節                    | 被災地支援        |           |           |           |           |           |
|                      | 5,153        |           |           |           |           |           |
| 調                    | 新型コロナ支援      |           |           |           |           |           |
|                      | 450,038      |           |           |           |           |           |
| 節                    | 国債補完供給       |           | -2,400    | -2,400    | -2,400    | -2,400    |
|                      | +200         | +200      | +200      | +200      | +200      | +200      |
| 調                    | 貸出支援基金(成長)   |           |           |           |           |           |
|                      | 71,489       |           |           |           |           |           |
| 節                    | (増加) 616,304 |           |           |           |           |           |
|                      | 小計           | -1,300    | -3,700    | -3,700    | -3,700    | -3,700    |
| 当預増減                 | -2,800       | -5,100    | -5,100    | -5,100    | -5,100    | -5,100    |
| 当座預金残高               | 4,876,900    | 4,874,600 | 4,874,600 | 4,874,600 | 4,874,600 | 4,874,600 |
| 準備預金残高               |              | 4,258,000 | 4,258,000 | 4,258,000 | 4,258,000 | 4,258,000 |
| 積み終了先超過準備            |              | 4,257,900 | 4,257,900 | 4,257,900 | 4,257,900 | 4,257,900 |
| 非準備先残高               |              | 4,254,600 | 4,254,600 | 4,254,600 | 4,254,600 | 4,254,600 |
| マネタリーベース             |              | 616,600   | 616,600   | 616,600   | 616,600   | 616,600   |
| マネタリーベース             |              |           | 6,060,300 | 6,060,300 | 6,060,300 | 6,060,300 |
| 積み期間の所要準備額(積数)       |              |           |           |           |           | 確報        |
| 10/1日以降の残所要積立額(積数)   |              |           |           |           |           | 200       |
| 10/1日以降の残所要積立額(1日平均) |              |           |           |           |           | 0         |
| 9/30日以降の残所要積立額(積数)   |              |           |           |           |           | 3,600     |
| 9/30日以降の残所要積立額(1日平均) |              |           |           |           |           | 200       |
| 準備預金進捗率(%)           | 実績           | 99.99%    | 日数        | 50.00%    |           |           |

## 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    | 101,311 | -37,278 | 80,838  | -36,854 | 20,473 | -424  |
|       |         |         | (うち0/N) | (前日比)   |        |       |
|       |         |         | 60,625  | -17,944 |        |       |

## 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  | -0.061    | -0.085 | 0.001 |              |        |        |
| TN  |           |        |       | -0.008       | -0.030 | -0.001 |
| SN  |           |        |       |              |        |        |
| 2日  |           |        |       |              |        |        |
| 3日  |           |        |       |              |        |        |
| 4日  |           |        |       |              |        |        |
| 5日  |           |        |       |              |        |        |
| 6日  |           |        |       |              |        |        |
| 1W  | -0.030    |        |       |              |        |        |
| 2W  |           |        |       | -0.039       | -0.045 | 0.000  |
| 3W  |           |        |       |              |        |        |
| 1M  |           |        |       | -0.010       | -0.020 | 0.180  |
| 2M  |           |        |       |              |        |        |
| 3M  |           |        |       | 0.080        |        |        |
| 4M  |           |        |       |              |        |        |
| 5M  |           |        |       |              |        |        |
| 6M  |           |        |       |              |        |        |
| 7M  |           |        |       |              |        |        |
| 8M  |           |        |       |              |        |        |
| 9M  |           |        |       |              |        |        |
| 10M |           |        |       |              |        |        |
| 11M |           |        |       |              |        |        |
| 1Y  |           |        |       |              |        |        |

| (参考)                          |           |
|-------------------------------|-----------|
| 積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(積数)   | 3,409,900 |
| 積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(1日平均) | 113,700   |

「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