

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2021年12月17日

[セントラル短資株式会社]

2021年12月16日(木)分
《 資金需給 》

単位：億円

需給	予想	速報	確報
銀行券要因	-3,200	-3,300	-3,300
財政等要因	-500	0	0
資金過不足	-3,700	-3,300	-3,300
貸出			
本店共通			
全店共通			
共通(固定)			
2,501			
手形売出			
-			
国債売現先(含米ドル)			
-			
国債買現先	-43,700	-43,700	-43,700
CP買現先			
-			
国短買入			
国庫短期証売却			
国債買入	+13,800	+13,800	+13,800
CP等買入			
-500	-500	-500	
社債買入	-100	-100	-100
ETF買入			
被災地支援			
5,324			
新型コロナ支援			
805,082			
国債補完供給		-200	-200
+300	+300	+300	
貸出支援基金 (成長) 60,298 (増加) 603,256			
小計	-30,200	-30,400	-30,400
当預増減	-33,900	-33,700	-33,700
当座預金残高	5,307,400	5,307,600	5,307,600
準備預金残高		4,693,700	4,693,900
積み終了先		3,527,500	3,529,200
超過準備		1,373,800	1,375,500
非準預先残高		613,900	613,700
マネタリーベース			6,553,000
積み期間の所要準備額(積数)			確報
12/17日以降の残り要積立額(積数)			450,900
12/17日以降の残り要積立額(1日平均)			15,000
12/16日以降の残り要積立額(積数)			3,769,300
12/16日以降の残り要積立額(1日平均)			121,600
準備預金進捗率(%)	実績	88.04%	日数
			73.33%

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	192,164	+32,137	174,171	+32,297	17,993	-160
			(うち0/N)	(前日比)		
			99,063	+30,217		

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	-0.033	-0.070	0.001			
TN				-0.036	-0.055	-0.010
SN						
2日						
3日						
4日						
5日	-0.015	-0.015	-0.015			
6日	-0.020	-0.020	-0.020			
1W	-0.021	-0.023	-0.020	-0.020	-0.020	-0.020
2W	-0.025	-0.045	-0.001			
3W						
1M				0.012	0.012	0.012
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)	3,769,300
積み期間(12/16~1/15日)の所要準備額(1日平均)	121,600

「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