

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2023年8月25日

[セントラル短資株式会社]

2023年8月24日(木)分

《 資金需給 》

単位：億円

| 需給                   |              | 予想        | 速報        | 確報      |
|----------------------|--------------|-----------|-----------|---------|
|                      | 銀行券要因        |           | -700      | -700    |
| 財政等要因                |              | +3,800    | +4,200    | +4,200  |
| 資金過不足                |              | +3,100    | +3,500    | +3,500  |
| 金<br>融<br>調<br>節     | 貸出           |           |           |         |
|                      | 本店共通         |           |           |         |
|                      | 全店共通         |           |           |         |
|                      | 共通(固定)       |           |           |         |
|                      | 手形売出         |           |           |         |
|                      | 国債売現先(含 米ドル) |           |           |         |
|                      | 国債買現先        |           |           |         |
|                      | CP買現先        |           |           |         |
|                      | 国短買入         |           |           |         |
|                      | 国庫短期証売却      |           |           |         |
|                      | 国債買入         | +10,800   | +10,800   | +10,800 |
|                      | CP等買入        | -200      | -200      | -200    |
|                      | 社債買入         |           |           |         |
|                      | ETF買入        |           |           |         |
|                      | 被災地支援        |           |           |         |
|                      | 気候変動対応       |           |           |         |
|                      | 国債補完供給       | +27,600   | -30,000   | -30,000 |
|                      | 貸出支援基金       |           | +27,600   | +27,600 |
|                      | 小計           | +38,200   | +8,200    | +8,200  |
|                      | 当預増減         | +41,300   | +11,700   | +11,700 |
| 当座預金残高               | 5,480,000    | 5,450,400 | 5,450,400 |         |
| 準備預金残高               | /            | 4,750,000 | 4,750,100 |         |
| 積み終了先                |              | 4,747,600 | 4,747,700 |         |
| 超過準備                 |              | 4,747,600 | 4,747,700 |         |
| 非準備先残高               |              | 700,400   | 700,300   |         |
| 積み期間の所要準備額(積数)       |              | 確報        |           |         |
| 8/25日以降の残り要積立額(積数)   |              | 21,700    |           |         |
| 8/25日以降の残り要積立額(1日平均) |              | 1,000     |           |         |
| 8/24日以降の残り要積立額(積数)   |              | 24,100    |           |         |
| 8/24日以降の残り要積立額(一日平均) |              | 1,000     |           |         |
| 準備預金進捗率(%)           |              | 実績        | 99.46%    |         |
|                      |              | 日数        | 29.03%    |         |

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    | 195,803 | +2,431 | 168,889 | +3,696 | 26,914 | -1,265 |
|       |         |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |        |
|       |         |        | 86,536  | +3,176 |        |        |

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  | -0.063    | -0.087 | 0.001  |              |        |        |
| TN  |           |        |        |              |        |        |
| SN  |           |        |        | -0.065       | -0.065 | -0.065 |
| 2日  |           |        |        |              |        |        |
| 3日  |           |        |        |              |        |        |
| 4日  |           |        |        |              |        |        |
| 5日  |           |        |        |              |        |        |
| 6日  |           |        |        | -0.064       | -0.070 | -0.060 |
| 1W  | -0.071    | -0.072 | -0.069 |              |        |        |
| 2W  | -0.065    | -0.065 | -0.065 |              |        |        |
| 3W  |           |        |        |              |        |        |
| 1M  |           |        |        |              |        |        |
| 2M  |           |        |        |              |        |        |
| 3M  |           |        |        |              |        |        |
| 4M  |           |        |        |              |        |        |
| 5M  |           |        |        |              |        |        |
| 6M  |           |        |        |              |        |        |
| 7M  |           |        |        |              |        |        |
| 8M  |           |        |        |              |        |        |
| 9M  |           |        |        |              |        |        |
| 10M |           |        |        |              |        |        |
| 11M |           |        |        |              |        |        |
| 1Y  |           |        |        |              |        |        |

マネタリーベース 6,710,000

| (参考)                         |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(積数)   | 4,009,600 |
| 積み期間(8/16~9/15日)の所要準備額(1日平均) | 129,300   |

「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