

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成26年3月28日

[セントラル短資株式会社]

平成26年3月27日(木)分  
《 資金需給 》

単位：億円

| 需給                         |         | 予想     | 速報        | 確報        |
|----------------------------|---------|--------|-----------|-----------|
|                            | 銀行券要因   |        | -2,200    | -2,400    |
| 財政等要因                      |         | -2,000 | -1,300    | -1,300    |
| 資金過不足                      |         | -4,200 | -3,700    | -3,700    |
| 融調                         | 貸出      |        |           |           |
|                            | 本店共通    |        |           |           |
|                            | 全店共通    |        |           |           |
|                            | 共通(固定)  |        |           |           |
|                            | 147,384 |        |           |           |
|                            | 手形売出    |        |           |           |
|                            | -       |        |           |           |
|                            | 国債売現先   |        |           |           |
|                            | -       |        |           |           |
|                            | 国債買現先   |        |           |           |
|                            | -       |        |           |           |
|                            | CP買現先   |        |           |           |
|                            | -       |        |           |           |
|                            | 国短買入    |        |           |           |
|                            | 国庫短期証売却 |        |           |           |
|                            | 国債買入    |        |           |           |
| CP等買入                      |         | -500   | -500      | -500      |
| 社債買入                       |         |        |           |           |
| ETF買入                      |         | +100   | +100      | +100      |
| 被災地支援                      |         |        |           |           |
| 3,805                      |         |        |           |           |
| 国債補完供給                     |         |        | -200      | -200      |
| 貸出支援基金                     |         |        |           |           |
| (成長) 33,429                |         |        |           |           |
| (増加) 85,512                |         |        |           |           |
| 小計                         |         | -400   | -600      | -600      |
| 当増減                        |         | -4,600 | -4,300    | -4,300    |
| 当座預金残高                     | /       |        | 1,271,700 | 1,271,700 |
| 準備預金残高                     |         |        | 1,162,000 | 1,162,900 |
| 積み終了先                      |         |        | 969,500   | 970,400   |
| 超過準備                       |         |        | 964,400   | 965,300   |
| 非準備先残高                     |         |        | 109,700   | 108,800   |
| マネタリーベース                   |         |        |           | 2,183,400 |
| (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) |         |        |           | 976,000   |
| 積み期間の所要準備額(積数)             |         |        |           | 確報        |
| 3/28日以降の残り要積立額(積数)         |         |        |           | 66,000    |
| 3/28日以降の残り要積立額(1日平均)       |         |        |           | 3,500     |
| 3/27日以降の残り要積立額(積数)         |         |        |           | 81,000    |
| 3/27日以降の残り要積立額(1日平均)       |         |        |           | 4,100     |
| 準備預金進捗率(%)                 | 実績      | 96.47% | 日数        | 38.71%    |

## 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    | 166,688 | -7,212 | 56,258 | -3,274 | 110,430 | -3,938 |

## 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 | 0.041     | 0.040 | 0.050 |              |    |    |
| 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  | 0.070     | 0.060 | 0.121 |              |       |       |
| TN  |           |       |       | 0.080        | 0.065 | 0.121 |
| SN  |           |       |       | 0.030        |       |       |
| 2日  |           |       |       |              |       |       |
| 3日  |           |       |       |              |       |       |
| 4日  |           |       |       |              |       |       |
| 5日  |           |       |       |              |       |       |
| 6日  |           |       |       |              |       |       |
| 1W  |           |       |       | 0.091        | 0.088 | 0.117 |
| 2W  |           |       |       | 0.118        |       |       |
| 3W  |           |       |       |              |       |       |
| 1M  |           |       |       | 0.118        |       |       |
| 2M  |           |       |       |              |       |       |
| 3M  |           |       |       | 0.125        |       |       |
| 4M  |           |       |       |              |       |       |
| 5M  |           |       |       |              |       |       |
| 6M  |           |       |       |              |       |       |
| 7M  |           |       |       |              |       |       |
| 8M  |           |       |       |              |       |       |
| 9M  |           |       |       |              |       |       |
| 10M |           |       |       |              |       |       |
| 11M |           |       |       |              |       |       |
| 1Y  |           |       |       |              |       |       |

| (参考)                         |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(3/16~4/15日)の所要準備額(積数)   | 1,870,000 |
| 積み期間(3/16~4/15日)の所要準備額(1日平均) | 60,300    |

「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。