

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成27年3月16日(月)分  
《 資金需給 》

平成27年3月17日  
[セントラル短資株式会社]

単位：億円

| 需給                           |              | 予想     | 速報        | 確報        |
|------------------------------|--------------|--------|-----------|-----------|
|                              | 銀行券要因        | +1,200 | +1,000    | +1,000    |
|                              | 財政等要因        | -6,800 | -8,000    | -8,000    |
|                              | 資金過不足        | -5,600 | -7,000    | -7,000    |
| 金<br><br>融<br><br>調<br><br>節 | 貸出           |        |           |           |
|                              | 本店共通         |        |           |           |
|                              | -            |        |           |           |
|                              | 全店共通         |        |           |           |
|                              | -            |        |           |           |
|                              | 共通(固定)       |        |           |           |
|                              | 65,430       |        |           |           |
|                              | 手形売出         |        |           |           |
|                              | -            |        |           |           |
|                              | 国債売現先        |        |           |           |
|                              | -            |        |           |           |
|                              | 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         |        |           |           |
|                              | C P 等買入      |        |           |           |
|                              |              | -400   | -400      | -400      |
|                              | 社債買入         | -200   | -200      | -200      |
|                              | ETF買入        | +300   | +300      | +300      |
|                              | 被災地支援        |        |           |           |
|                              | 3,252        |        |           |           |
|                              | 国債補完供給       | +200   | +200      | +200      |
|                              | 貸出支援基金       |        |           |           |
|                              | (成長) 46,898  |        |           |           |
|                              | (増加) 189,789 |        |           |           |
|                              | 小計           | -100   | -100      | -100      |
|                              | 当預増減         | -5,700 | -7,100    | -7,100    |
|                              | 当座預金残高       |        | 1,834,300 | 1,834,300 |
|                              | 準備預金残高       |        | 1,677,300 | 1,677,800 |
|                              | 積み終了先        |        | 456,700   | 456,900   |
|                              | 超過準備         |        | 339,800   | 340,100   |
|                              | 非準備先残高       |        | 157,000   | 156,500   |

マネタリーベース 2,769,800

(参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀) 1,383,000

| 積み期間の所要準備額(積数)       | 確報        |
|----------------------|-----------|
| 3/17日以降の残り要積立額(積数)   | 927,500   |
| 3/17日以降の残り要積立額(1日平均) | 30,900    |
| 3/16日以降の残り要積立額(積数)   | 1,971,500 |
| 3/16日以降の残り要積立額(1日平均) | 63,600    |

準備預金進捗率(%) 実績 52.95% 日数 3.23%

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   | 211,635 | -7,229 | 82,845 | -4,953 | 128,790 | -2,276 |

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 | 0.031     | 0.030 | 0.040 |              |    |    |
| 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  | 0.075     | 0.060 | 0.130 |              |       |       |
| TN  |           |       |       | 0.095        | 0.075 | 0.120 |
| SN  |           |       |       | 0.100        |       |       |
| 2日  | 0.050     |       |       | 0.072        |       |       |
| 3日  |           |       |       |              |       |       |
| 4日  |           |       |       |              |       |       |
| 5日  |           |       |       |              |       |       |
| 6日  |           |       |       |              |       |       |
| 1W  |           |       |       | 0.110        | 0.075 | 0.117 |
| 2W  |           |       |       | 0.118        | 0.115 | 0.118 |
| 3W  |           |       |       |              |       |       |
| 1M  | 0.200     |       |       |              |       |       |
| 2M  |           |       |       |              |       |       |
| 3M  |           |       |       |              |       |       |
| 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)   | 1,971,500 |
| 積み期間(3/16~4/15日)の所要準備額(1日平均) | 63,600    |

「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れ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