

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成28年11月11日

[セントラル短資株式会社]

平成28年11月10日(木)分  
《 資金需給 》

単位：億円

| 需給 |                                       | 予想      | 速報        | 確報        |
|----|---------------------------------------|---------|-----------|-----------|
|    |                                       | 銀行券要因   | +200      | +300      |
|    | 財政等要因                                 | -49,600 | -49,900   | -49,900   |
|    | 資金過不足                                 | -49,400 | -49,600   | -49,600   |
| 金  | 貸出                                    |         |           |           |
|    | 本店共通                                  |         |           |           |
|    | 全店共通                                  |         |           |           |
| 融  | 共通(固定)                                |         |           |           |
|    | 4,420                                 |         |           |           |
|    | 手形売出                                  |         |           |           |
| 調  | 国債売現先(含米ドル)                           |         |           |           |
|    | -                                     |         |           |           |
|    | 国債買現先                                 |         |           |           |
|    | -                                     |         |           |           |
| 節  | CP買現先                                 |         |           |           |
|    | -                                     |         |           |           |
|    | 国短買入                                  |         |           |           |
|    | 国庫短期証売却                               |         |           |           |
|    | 国債買入                                  |         |           |           |
|    | CP等買入                                 |         |           |           |
|    | 社債買入                                  |         |           |           |
|    | ETF買入                                 |         |           |           |
|    | 被災地支援等                                |         |           |           |
|    | 5,051                                 |         |           |           |
|    | 国債補完供給                                |         | -100      | -100      |
|    |                                       | +900    | +900      | +900      |
|    | 貸出支援基金<br>(成長) 71,647<br>(増加) 374,549 |         |           |           |
|    | 小計                                    | +600    | +500      | +500      |
|    | 当預増減                                  | -48,800 | -49,100   | -49,100   |
|    | 当座預金残高                                |         | 3,151,500 | 3,151,500 |
|    | 準備預金残高                                |         | 2,861,300 | 2,861,600 |
|    | 積み終了先                                 |         | 2,399,400 | 2,399,700 |
|    | 超過準備                                  |         | 2,399,400 | 2,399,700 |
|    | 非準備先残高                                |         | 290,200   | 289,900   |
|    | マネタリーベース                              |         |           | 4,164,700 |
|    | (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)            |         |           | 2,387,000 |
|    | 積み期間の所要準備額(積数)                        |         |           | 確報        |
|    | 11/11日以降の残りに要積立額(積数)                  |         |           | 1,400     |
|    | 11/11日以降の残りに要積立額(1日平均)                |         |           | 300       |
|    | 11/10日以降の残りに要積立額(積数)                  |         |           | 1,900     |
|    | 11/10日以降の残りに要積立額(1日平均)                |         |           | 300       |
|    | 準備預金進捗率(%)                            | 実績      | 99.94%    | 日数        |
|    |                                       |         |           | 83.87%    |

## 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    | 94,367 | +3,013 | 74,550 | +1,972 | 19,817 | +1,041 |

## 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  | -0.050    | -0.075 | 0.001 |              |       |       |
| TN  |           |        |       | -0.005       |       |       |
| SN  |           |        |       |              |       |       |
| 2日  |           |        |       |              |       |       |
| 3日  |           |        |       |              |       |       |
| 4日  |           |        |       |              |       |       |
| 5日  |           |        |       |              |       |       |
| 6日  |           |        |       |              |       |       |
| 1W  |           |        |       | 0.058        | 0.000 | 0.120 |
| 2W  |           |        |       |              |       |       |
| 3W  |           |        |       |              |       |       |
| 1M  |           |        |       |              |       |       |
| 2M  |           |        |       |              |       |       |
| 3M  |           |        |       |              |       |       |
| 4M  |           |        |       |              |       |       |
| 5M  |           |        |       |              |       |       |
| 6M  |           |        |       |              |       |       |
| 7M  |           |        |       |              |       |       |
| 8M  |           |        |       |              |       |       |
| 9M  |           |        |       |              |       |       |
| 10M |           |        |       |              |       |       |
| 11M |           |        |       |              |       |       |
| 1Y  |           |        |       |              |       |       |

| (参考)                           |           |
|--------------------------------|-----------|
| 積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(積数)   | 2,170,600 |
| 積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(1日平均) | 70,000    |

「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