

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

平成29年12月15日

[セントラル短資株式会社]

## 平成29年12月14日(木)分 《 資金需給 》

単位：億円

| 需給                                    |         | 予想        | 速報        | 確報     |
|---------------------------------------|---------|-----------|-----------|--------|
|                                       |         | 銀行券要因     | -2,900    | -2,800 |
|                                       | 財政等要因   | +3,600    | +2,400    | +2,400 |
|                                       | 資金過不足   | +700      | -400      | -400   |
| 融<br>調<br>節                           | 貸出      |           |           |        |
|                                       | 本店共通    |           |           |        |
|                                       | 全店共通    |           |           |        |
|                                       | 共通(固定)  |           |           |        |
|                                       | 5,803   |           |           |        |
|                                       | 手形売出    |           |           |        |
|                                       | -       |           |           |        |
|                                       | 国債売現先   |           |           |        |
|                                       | -2      |           |           |        |
|                                       | 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   |           |           |        |
|                                       |         | -100      | -100      | -100   |
|                                       | 社債買入    | -100      | -100      | -100   |
|                                       | ETF買入   | +200      | +200      | +200   |
| 被災地支援等                                |         |           |           |        |
| 5,087                                 |         |           |           |        |
| 国債補完供給                                |         | -300      | -300      |        |
|                                       | +300    | +300      | +300      |        |
| 貸出支援基金<br>(成長) 98,295<br>(増加) 529,457 |         |           |           |        |
| 小計                                    | +300    | 0         | 0         |        |
| 当預増減                                  | +1,000  | -400      | -400      |        |
| 当座預金残高                                |         | 3,608,400 | 3,608,400 |        |
| 準備預金残高                                |         | 3,195,800 | 3,196,100 |        |
| 積み終了先                                 |         | 3,195,800 | 3,196,000 |        |
| 超過準備                                  |         | 3,195,700 | 3,195,900 |        |
| 非準備先残高                                |         | 412,600   | 412,300   |        |
| マネタリーベース                              |         |           | 4,693,300 |        |
| (参考) 当日朝方発表の準備預金先残高見込み(日銀)            |         |           | 3,195,000 |        |
| 積み期間の所要準備額(積数)                        |         |           | 確報        |        |
| 12/15日以降の残り要積立額(積数)                   |         |           | 100       |        |
| 12/15日以降の残り要積立額(1日平均)                 |         |           | 100       |        |
| 12/14日以降の残り要積立額(積数)                   |         |           | 200       |        |
| 12/14日以降の残り要積立額(1日平均)                 |         |           | 100       |        |
| 準備預金進捗率(%)                            | 実績      | 100.00%   | 日数        | 96.67% |

### 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    | 93,160 | +909 | 72,240  | +1,061 | 20,920 | -152  |
|       |        |      | (うち0/N) | (前日比)  |        |       |
|       |        |      | 43,690  | +581   |        |       |

### 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  | -0.026    | -0.040 | 0.001 |              |        |        |
| TN  |           |        |       | 0.000        |        |        |
| SN  |           |        |       |              |        |        |
| 2日  |           |        |       |              |        |        |
| 3日  |           |        |       |              |        |        |
| 4日  |           |        |       |              |        |        |
| 5日  |           |        |       |              |        |        |
| 6日  |           |        |       |              |        |        |
| 1W  |           |        |       | -0.033       | -0.045 | -0.025 |
| 2W  |           |        |       | -0.045       |        |        |
| 3W  |           |        |       | 0.060        |        |        |
| 1M  |           |        |       |              |        |        |
| 2M  |           |        |       |              |        |        |
| 3M  |           |        |       |              |        |        |
| 4M  |           |        |       |              |        |        |
| 5M  |           |        |       |              |        |        |
| 6M  |           |        |       |              |        |        |
| 7M  |           |        |       |              |        |        |
| 8M  |           |        |       |              |        |        |
| 9M  |           |        |       |              |        |        |
| 10M |           |        |       |              |        |        |
| 11M |           |        |       |              |        |        |
| 1Y  |           |        |       |              |        |        |

| (参考)                           |           |
|--------------------------------|-----------|
| 積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(積数)   | 2,950,300 |
| 積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(1日平均) | 98,300    |

「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