

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2019年10月11日

[セントラル短資株式会社]

2019年10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     |           | -1,100    | -1,200 | -1,200 |
| 財政等要因                                 |           | -6,300    | -6,400    | -6,400 |        |
| 資金過不足                                 |           | -7,400    | -7,600    | -7,600 |        |
| 融<br>調<br>節                           | 貸出        |           |           |        |        |
|                                       | 本店共通      |           |           |        |        |
|                                       | 全店共通      |           |           |        |        |
|                                       | 共通(固定)    |           |           |        |        |
|                                       | 3,836     |           |           |        |        |
|                                       | 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     |           | -100      | -100   | -100   |
|                                       | 社債買入      |           |           |        |        |
|                                       | ETF買入     |           |           |        |        |
|                                       | 被災地支援等    |           |           |        |        |
| 5,465                                 |           |           |           |        |        |
| 国債補完供給                                |           |           |           |        |        |
| 貸出支援基金<br>(成長) 81,649<br>(増加) 513,724 |           |           |           |        |        |
| 小計                                    |           | -100      | -100      | -100   |        |
| 当預増減                                  |           | -7,500    | -7,700    | -7,700 |        |
| 当座預金残高                                | 4,001,500 | 4,001,300 | 4,001,300 |        |        |
| 準備預金残高                                | /         | 3,483,500 | 3,483,500 |        |        |
| 積み終了先                                 |           | 3,483,300 | 3,483,300 |        |        |
| 超過準備                                  |           | 3,483,300 | 3,483,300 |        |        |
| 非準備先残高                                |           | 517,800   | 517,800   |        |        |

|                       |                     |
|-----------------------|---------------------|
| マネタリーベース              | 5,119,600           |
| 積み期間の所要準備額(積数)        | 確報                  |
| 10/11日以降の残所要積立額(積数)   | 500                 |
| 10/11日以降の残所要積立額(1日平均) | 100                 |
| 10/10日以降の残所要積立額(積数)   | 700                 |
| 10/10日以降の残所要積立額(1日平均) | 100                 |
| 準備預金進捗率(%)            | 実績 99.98% 日数 83.33% |

## 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    | 97,511 | +583 | 79,320  | +529  | 18,191 | +54   |
|       |        |      | (うち0/N) | (前日比) |        |       |
|       |        |      | 56,495  | +484  |        |       |

## 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  | -0.011    | -0.040 | 0.001  |              |       |       |
| TN  |           |        |        |              |       |       |
| SN  |           |        |        |              |       |       |
| 2日  |           |        |        |              |       |       |
| 3日  |           |        |        |              |       |       |
| 4日  |           |        |        |              |       |       |
| 5日  |           |        |        |              |       |       |
| 6日  | -0.012    | -0.015 | -0.010 |              |       |       |
| 1W  |           |        |        | -0.020       |       |       |
| 2W  |           |        |        | -0.005       |       |       |
| 3W  | -0.010    |        |        | 0.008        | 0.001 | 0.030 |
| 1M  |           |        |        |              |       |       |
| 2M  |           |        |        |              |       |       |
| 3M  |           |        |        |              |       |       |
| 4M  |           |        |        |              |       |       |
| 5M  |           |        |        |              |       |       |
| 6M  |           |        |        |              |       |       |
| 7M  |           |        |        |              |       |       |
| 8M  |           |        |        |              |       |       |
| 9M  |           |        |        |              |       |       |
| 10M |           |        |        |              |       |       |
| 11M |           |        |        |              |       |       |
| 1Y  |           |        |        |              |       |       |

| (参考)                          |           |
|-------------------------------|-----------|
| 積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(積数)   | 3,090,800 |
| 積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(1日平均) | 103,000   |

「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