

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年4月2日

[セントラル短資株式会社]

## 2020年4月1日(水)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        | -25,400        | -24,900        | -24,900        |
|    | 資金過不足        | -25,600        | -25,200        | -25,200        |
| 金  | 貸出           |                |                |                |
|    | 本店共通         |                |                |                |
|    | 全店共通         |                |                |                |
|    | 共通(固定)       |                |                |                |
|    | 12,270       |                |                |                |
|    | 手形売出         |                |                |                |
|    | -            |                |                |                |
|    | 国債売現先(含米ドル)  | -20,500        | -20,500        | -20,500        |
|    | -249,038     | (うち米ドル)-40,600 | (うち米ドル)-40,600 | (うち米ドル)-40,600 |
|    | 国債買現先        |                |                |                |
| 融  | CP買現先        |                |                |                |
|    | -            |                |                |                |
|    | 国短買入         | +2,500         | +2,500         | +2,500         |
|    | 国庫短期証売却      |                |                |                |
|    | 国債買入         |                |                |                |
|    | CP等買入        |                |                |                |
|    | 社債買入         |                |                |                |
|    | ETF買入        | +200           | +200           | +200           |
|    | 被災地支援等       |                |                |                |
|    | 5,445        |                |                |                |
| 調  | 新型コロナ支援      |                |                |                |
|    | 国債補完供給       |                | -1,200         | -1,200         |
|    | +8,600       | +8,600         | +8,600         |                |
|    | 貸出支援基金       |                |                |                |
|    | (成長) 78,310  |                |                |                |
|    | (増加) 532,345 |                |                |                |
|    | 小計           | -9,200         | -10,400        | -10,400        |
|    | 当預増減         | -34,800        | -35,600        | -35,600        |
|    | 当座預金残高       | 3,917,800      | 3,917,000      | 3,917,000      |
|    | 準備預金残高       |                | 3,399,800      | 3,399,800      |
| 融  | 積み終了先        |                | 3,399,400      | 3,399,400      |
|    | 超過準備         |                | 3,398,600      | 3,398,600      |
|    | 非準備先残高       |                | 517,200        | 517,200        |

|                     |                     |
|---------------------|---------------------|
| マネタリーベース            | 5,062,800           |
| 積み期間の所要準備額(積数)      | 確報                  |
| 4/2日以降の残り要積立額(積数)   | 2,300               |
| 4/2日以降の残り要積立額(1日平均) | 200                 |
| 4/1日以降の残り要積立額(積数)   | 3,500               |
| 4/1日以降の残り要積立額(1日平均) | 200                 |
| 準備預金進捗率(%)          | 実績 99.93% 日数 54.84% |

## 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    | 119,308 | +28,322 | 103,368 | +19,067 | 15,940 | +9,255 |
|       |         |         | (うち0/N) | (前日比)   |        |        |
|       |         |         | 79,685  | +16,482 |        |        |

## 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  | -0.022    | -0.087 | 0.001  |              |        |       |
| TN  |           |        |        | -0.080       |        |       |
| SN  |           |        |        |              |        |       |
| 2日  |           |        |        |              |        |       |
| 3日  |           |        |        |              |        |       |
| 4日  |           |        |        |              |        |       |
| 5日  |           |        |        |              |        |       |
| 6日  |           |        |        |              |        |       |
| 1W  | -0.005    | -0.008 | 0.001  | -0.006       | -0.008 | 0.002 |
| 2W  | -0.008    | -0.010 | -0.005 | -0.003       | -0.010 | 0.000 |
| 3W  |           |        |        | 0.003        | 0.000  | 0.005 |
| 1M  | 0.000     |        |        | 0.030        | 0.000  | 0.180 |
| 2M  |           |        |        |              |        |       |
| 3M  |           |        |        | 0.005        |        |       |
| 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)   | 3,247,700 |
| 積み期間(3/16~4/15日)の所要準備額(1日平均) | 104,800   |

「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