

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年8月5日

[セントラル短資株式会社]

2020年8月4日(火)分  
《 資金需給 》

単位：億円

|                     |                                       | 予想        | 速報        | 確報      |
|---------------------|---------------------------------------|-----------|-----------|---------|
| 需給                  | 銀行券要因                                 | +300      | +500      | +500    |
|                     | 財政等要因                                 | -58,500   | -58,600   | -58,600 |
|                     | 資金過不足                                 | -58,200   | -58,100   | -58,100 |
|                     | 貸出                                    |           |           |         |
| 金                   | 本店共通                                  |           |           |         |
|                     | 全店共通                                  |           |           |         |
| 融                   | 共通(固定)                                |           |           |         |
|                     | 3,061                                 |           |           |         |
|                     | 手形売出                                  |           |           |         |
| 調                   | 国債売現先(含 米ドル)                          |           |           |         |
|                     | -34,635                               |           |           |         |
|                     | 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                                  | +4,500    | +4,500    | +4,500  |
|                     | C P等買入                                |           |           |         |
| 節                   | 社債買入                                  |           |           |         |
|                     | ETF買入                                 | +100      | +100      | +100    |
|                     | 被災地支援                                 |           |           |         |
|                     | 4,123                                 |           |           |         |
|                     | 新型コロナ支援                               |           |           |         |
|                     | 271,352                               |           |           |         |
|                     | 国債補完供給                                |           | -600      | -600    |
|                     | 貸出支援基金<br>(成長) 74,135<br>(増加) 533,496 |           |           |         |
|                     | 小計                                    | +4,600    | +4,000    | +4,000  |
|                     | 当預増減                                  | -53,600   | -54,100   | -54,100 |
| 当座預金残高              | 4,479,000                             | 4,478,500 | 4,478,500 |         |
| 準備預金残高              |                                       | 3,901,700 | 3,901,800 |         |
| 積み終了先<br>超過準備       |                                       | 3,901,700 | 3,901,700 |         |
| 非準備先残高              |                                       | 576,800   | 576,700   |         |
| マネタリーベース            |                                       |           | 5,666,000 |         |
| 積み期間の所要準備額(積数)      |                                       |           |           | 確報      |
| 8/5日以降の残り要積立額(積数)   |                                       |           |           | 600     |
| 8/5日以降の残り要積立額(1日平均) |                                       |           |           | 100     |
| 8/4日以降の残り要積立額(積数)   |                                       |           |           | 700     |
| 8/4日以降の残り要積立額(1日平均) |                                       |           |           | 100     |
| 準備預金進捗率(%)          | 実績                                    | 99.98%    | 日数        | 64.52%  |

## 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    | 111,842 | +4,712 | 92,615  | +3,622 | 19,227 | +1,090 |
|       |         |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |        |
|       |         |        | 60,857  | +3,472 |        |        |

## 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  | -0.021    | -0.060 | 0.001 |              |    |    |
| TN  |           |        |       | -0.001       |    |    |
| SN  |           |        |       |              |    |    |
| 2日  |           |        |       |              |    |    |
| 3日  |           |        |       |              |    |    |
| 4日  |           |        |       |              |    |    |
| 5日  |           |        |       |              |    |    |
| 6日  |           |        |       |              |    |    |
| 1W  | -0.020    |        |       | 0.000        |    |    |
| 2W  | -0.005    |        |       |              |    |    |
| 3W  |           |        |       |              |    |    |
| 1M  |           |        |       |              |    |    |
| 2M  |           |        |       |              |    |    |
| 3M  |           |        |       |              |    |    |
| 4M  |           |        |       |              |    |    |
| 5M  |           |        |       |              |    |    |
| 6M  |           |        |       |              |    |    |
| 7M  |           |        |       |              |    |    |
| 8M  |           |        |       |              |    |    |
| 9M  |           |        |       |              |    |    |
| 10M |           |        |       |              |    |    |
| 11M |           |        |       |              |    |    |
| 1Y  |           |        |       |              |    |    |

## (参考)

|                              |           |
|------------------------------|-----------|
| 積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(積数)   | 3,473,200 |
| 積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(1日平均) | 112,000   |

「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せ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