

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年10月19日

[セントラル短資株式会社]

2020年10月16日(金)分 《 資金需給 》

単位：億円

	予想	速報	確報	
需給	銀行券要因	0	0	
	財政等要因	+700	+1,100	
	資金過不足	+700	+1,100	
金 融 調 節	貸出			
	本店共通			
	全店共通			
	共通(固定)			
	2,311			
	手形売出			
	-			
	国債売現先(含 米ドル)			
	-			
	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			
	社債買入	-300	-300	-300
	ETF買入	-200	-200	-200
	被災地支援	+100	+100	+100
5,153	-100	-100	-100	
新型コロナ支援				
450,038				
国債補完供給		-100	-100	
貸出支援基金 (成長) 71,489 (増加) 616,304				
小計	-500	-600	-600	
当預増減	+200	+500	+500	
当座預金残高	4,868,800	4,869,100	4,869,100	
準備預金残高		4,246,900	4,246,900	
積み終了先		4,229,600	4,229,600	
超過準備		3,073,500	3,073,500	
非準備先残高		622,200	622,200	
マネタリーベース			6,052,800	
積み期間の所要準備額(積数)			確報	
10/19日以降の残り要積立額(積数)			17,100	
10/19日以降の残り要積立額(1日平均)			600	
10/16日以降の残り要積立額(積数)			3,537,500	
10/16日以降の残り要積立額(1日平均)			114,100	
準備預金進捗率(%)	実績	99.52%	日数	
			9.68%	

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	126,744	+22,076	105,812	+21,745	20,932	+331
			(うち0/N)	(前日比)		
			72,189	+21,615		

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	-0.033	-0.080	0.001			
TN				-0.001		
SN						
2日						
3日						
4日						
5日						
6日						
1W	-0.022	-0.030	-0.015			
2W	-0.024	-0.030	-0.018	-0.010		
3W				0.030		
1M	-0.023	-0.035	-0.008	0.200		
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)	3,537,500
積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(1日平均)	114,100

「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