

# 《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2020年11月18日

[セントラル短資株式会社]

2020年11月17日(火)分  
《 資金需給 》

単位：億円

| 需給                                    | 予想           |        | 速報     |           | 確報     |           |
|---------------------------------------|--------------|--------|--------|-----------|--------|-----------|
|                                       | 銀行券要因        | 財政等要因  | 資金過不足  | 銀行券要因     | 財政等要因  | 資金過不足     |
|                                       | +400         | -6,100 | -5,700 | +400      | -2,900 | -2,500    |
|                                       |              |        |        |           |        |           |
| 金                                     | 貸出           |        |        |           |        |           |
|                                       | 本店共通         |        |        |           |        |           |
|                                       | 全店共通         |        |        |           |        |           |
|                                       | 共通(固定)       |        |        |           |        |           |
|                                       | 1,601        |        |        |           |        |           |
|                                       | 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                                 |              |        |        |           |        |           |
|                                       | -200         |        |        | -200      |        | -200      |
| 社債買入                                  |              |        |        |           |        |           |
| ETF買入                                 |              |        |        |           |        |           |
| 被災地支援                                 |              |        |        |           |        |           |
| 5,153                                 |              |        |        |           |        |           |
| 新型コロナ支援                               |              |        |        |           |        |           |
| 477,598                               |              |        |        |           |        |           |
| 国債補完供給                                |              |        |        |           |        |           |
|                                       | +600         |        |        | -500      |        | -500      |
| 貸出支援基金<br>(成長) 71,489<br>(増加) 616,304 |              |        |        | +600      |        | +600      |
| 小計                                    | +1,200       |        |        | +700      |        | +700      |
| 当預増減                                  | -4,500       |        |        | -1,800    |        | -1,800    |
| 当座預金残高                                | 4,798,300    |        |        | 4,801,000 |        | 4,801,000 |
| 準備預金残高                                |              |        |        | 4,200,100 |        | 4,200,200 |
| 積み終了先<br>超過準備                         |              |        |        | 4,146,400 |        | 4,146,500 |
| 非準備先残高                                |              |        |        | 3,770,500 |        | 3,770,500 |
|                                       |              |        |        | 600,900   |        | 600,800   |
| マネタリーベース                              |              |        |        |           |        | 5,986,700 |
| 積み期間の所要準備額(積数)                        |              |        |        |           |        | 確報        |
| 11/18日以降の残り要積立額(積数)                   |              |        |        |           |        | 43,300    |
| 11/18日以降の残り要積立額(1日平均)                 |              |        |        |           |        | 1,500     |
| 11/17日以降の残り要積立額(積数)                   |              |        |        |           |        | 473,000   |
| 11/17日以降の残り要積立額(1日平均)                 |              |        |        |           |        | 16,300    |
| 準備預金進捗率(%)                            | 実績           |        |        | 98.75%    | 日数     | 6.67%     |

## 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    | 116,214 | -6,341 | 96,181  | -5,982 | 20,033 | -359  |
|       |         |        | (うち0/N) | (前日比)  |        |       |
|       |         |        | 58,018  | -8,407 |        |       |

## 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  |           |        |        | -0.004       | -0.025 | -0.001 |
| SN  |           |        |        |              |        |        |
| 2日  | -0.030    |        |        |              |        |        |
| 3日  |           |        |        |              |        |        |
| 4日  |           |        |        |              |        |        |
| 5日  |           |        |        |              |        |        |
| 6日  |           |        |        |              |        |        |
| 1W  | -0.019    | -0.025 | -0.013 |              |        |        |
| 2W  |           |        |        | -0.023       | -0.025 | -0.020 |
| 3W  |           |        |        |              |        |        |
| 1M  | -0.023    |        |        |              |        |        |
| 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)   | 3,451,500 |
| 積み期間(11/16~12/15日)の所要準備額(1日平均) | 115,000   |

「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