

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2021年9月30日

[セントラル短資株式会社]

2021年9月29日(水)分
《 資金需給 》

単位：億円

需給	予想		速報		確報	
	銀行券要因	-300	-500	-500	-500	-500
財政等要因	-17,100	-11,900	-11,900	-11,900	-11,900	-11,900
資金過不足	-17,400	-12,400	-12,400	-12,400	-12,400	-12,400
金	貸出					
	本店共通					
融	全店共通					
	共通(固定)	+4,000	+4,000	+4,000	+4,000	+4,000
調	3,951	-2,900	-2,900	-2,900	-2,900	-2,900
	手形売出					
節	国債売現先(含米ドル)					
	国債買現先					
節	CP買現先					
	国短買入	+1,000	+1,000	+1,000	+1,000	+1,000
節	国庫短期証券売却					
	国債買入					
節	CP等買入	-800	-800	-800	-800	-800
	社債買入					
節	ETF買入					
	被災地支援					
節	5,324					
	新型コロナ支援					
節	780,292					
	国債補完供給		-100	-100	-100	-100
節	貸出支援基金					
	(成長) 64,017 (増加) 612,072					
小計	+1,300	+1,200	+1,200	+1,200	+1,200	+1,200
当増減	-16,100	-11,200	-11,200	-11,200	-11,200	-11,200
当座預金残高	5,413,100	5,418,000	5,418,000	5,418,000	5,418,000	5,418,000
準備預金残高		4,800,300	4,800,300	4,800,300	4,800,300	4,800,300
積み終了先		4,799,300	4,799,300	4,799,300	4,799,300	4,799,300
超過準備		4,799,300	4,799,300	4,799,300	4,799,300	4,799,300
非準備先残高		617,700	617,700	617,700	617,700	617,700

積み期間の所要準備額(積数)		確報	
9/30日以降の残り要積立額(積数)		1,900	
9/30日以降の残り要積立額(1日平均)		100	
9/29日以降の残り要積立額(積数)		3,000	
9/29日以降の残り要積立額(1日平均)		200	

準備預金進捗率(%)	実績	99.95%	日数	46.67%
------------	----	--------	----	--------

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	168,105	-13,116	149,834	-14,031	18,271	+915
			(うち0/N)	(前日比)		
			62,111	-13,851		

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	-0.025	-0.070	0.001			
TN				-0.001	-0.001	-0.001
SN				-0.005	-0.005	-0.005
2日	-0.001	-0.001	-0.001			
3日						
4日				-0.016	-0.018	-0.015
5日						
6日						
1W	-0.001	-0.001	0.001	-0.017	-0.055	0.045
2W				-0.013	-0.035	-0.001
3W				0.000	-0.001	0.001
1M				-0.005	-0.012	0.000
2M						
3M						
4M						
5M						
6M						
7M						
8M						
9M						
10M						
11M						
1Y						

マネタリーベース	6,636,000
----------	-----------

(参考)	
積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(積数)	3,615,500
積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(1日平均)	120,500

「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