

《CENTRAL DAILY MARKET REPORT(確報)》

2021年10月18日

[セントラル短資株式会社]

2021年10月15日(金)分 《 資金需給 》

単位：億円

需給	予想		速報		確報	
	銀行券要因	+200	+100	+100	+100	
	財政等要因	+56,800	+57,900	+57,900	+57,900	
	資金過不足	+57,000	+58,000	+58,000	+58,000	
金 融 調 節	貸出					
	本店共通					
	全店共通					
	共通(固定)					
	2,351					
	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					
	国庫短期証券売却					
	国債買入					
	CP等買入					
	社債買入	-400	-400	-400	-400	
	ETF買入					
	被災地支援					
	5,324					
	新型コロナ支援					
	780,292					
	国債補完供給		-100	-100	-100	
貸出支援基金(成長)	+100	+100	+100	+100		
64,017						
(増加) 612,072						
小計	-500	-600	-600	-600		
当預増減	+56,500	+57,400	+57,400	+57,400		
当座預金残高	5,414,800	5,415,700	5,415,700	5,415,700		
準備預金残高		4,809,300	4,808,800	4,808,800		
積み終了先		4,809,300	4,808,800	4,808,800		
超過準備		4,809,300	4,808,800	4,808,800		
非準備預金残高		606,400	606,900	606,900		

積み期間の所要準備額(積数)	確報
積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(積数)	3,615,800
積み期間(9/16~10/15日)の所要準備額(1日平均)	120,500
10/15日以降の残り要積立額(積数)	0
10/15日以降の残り要積立額(1日平均)	0

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	160,141	-11,452	140,288	-12,184	19,853	+732
			(うち0/N)	(前日比)		
			72,665	-1,534		

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	-0.046	-0.087	0.001			
TN				-0.059	-0.059	-0.059
SN						
2日						
3日						
4日	-0.010	-0.010	-0.010			
5日						
6日						
1W	-0.001	-0.001	-0.001			
2W	-0.028	-0.045	-0.010	-0.013	-0.025	0.000
3W						
1M				0.003	-0.010	0.010
2M						
3M						
4M						
5M						
6M						
7M						
8M						
9M						
10M						
11M						
1Y						

マネタリーベース 6,632,500

(参考)	
積み期間(10/16~11/15日)の所要準備額(積数)	3,735,100
積み期間(10/16~11/15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