

Central Daily Market Report

2023年7月3日(月)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位: 億円	2023年7月3日 需給速報	2023年7月4日 需給予想	2023年7月5日 当社予想			
銀行券	300	100	500			
財政	▲ 32,600	▲ 33,400	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 32,300	▲ 33,300	▲ 26,500			
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						▲ 8,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	14,100					
CP等買入			▲ 200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
新型コロナウイルス対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 43,600	44,100	43,600			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 17,700	10,100	▲ 35,400			
当座預金残高	5,426,800	5,436,900	5,401,500			
準備預金残高	4,750,000					
積み終了先	4,749,700			7月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,749,700			積数	1,800	
非準備預金先	676,800			1日平均	200	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,883,300
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	60.00%		

●2023年7月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.075%前後での出合いが中心となり、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られた程度となった。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.06%程度での出合いとなった。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

3日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/7/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.078	0.400	0.005	33,753.33	564.29	144.38-41	144.82-85
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.005	▲ 0.054				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.073	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.110						
1M	▲ 0.064	0.250	0.020				-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.134	▲ 0.128						
6M							▲ 0.140	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
									日付	6/26	6/27	6/28	6/29	6/30
									日銀当預残	5,519,600	5,518,500	5,497,500	5,494,600	5,444,500
									準備預金残	4,864,700	4,870,000	4,848,500	4,831,600	4,767,200
									マネタリーベース	6,779,600	6,779,500	6,758,900	6,756,300	6,706,100
									無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.074%	▲0.076%	▲0.075%	▲0.077%
									コール市場残高	168,479	172,820	173,090	174,678	133,292
									うち無担	138,042	143,641	142,596	144,075	103,868
									うちO/N	64,314	69,541	69,846	73,525	57,643
									うち有担	30,437	29,179	30,494	30,603	29,424

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率*	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/4		0.105	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/7/4		0.295	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/3	2023/7/4	▲0.350	43,582	43,582		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/3	2023/7/4	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り。国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。
※1固定利回較差の結果、10年利付国債370回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※2固定利回較差の結果、10年利付国債360回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2023年7月4日の予定

*6月のマネタリーベース	*New York祝日(Independence Day)	*10年利付国債入札(27,000億円、7/5発行)
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み		

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされ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録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