

Central Daily Market Report

2023年7月4日(火)

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4日 需給速報	2023年7月5日 需給予想	2023年7月6日 当社予想			
銀行券	200	200	▲ 500			
財政	▲ 34,000	▲ 31,700	1,000			
資金過不足	▲ 33,800	▲ 31,500	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			6,300	▲ 8,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 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	▲ 41,300	43,600		41,300		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 31,700		8,000			500
当座預金残高	5,395,100		5,403,100			5,403,600
準備預金残高	4,707,100					
積み終了先	4,706,800				7月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,706,800				積数	1,600
非準備預金先	688,000				1日平均	100
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	99.96%		日数		63.33%

●2023年7月4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▲0.07~▲0.06%程度での出合いが中心となり、一巡後はレート水準が若干上昇し▲0.05%程度で散発的な出合いが見られた。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~▲0.07%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>

4日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットで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

2023/7/4	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N		▲ 0.087	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.077	0.395	▲ 0.005	33,422.52	▲ 330.81	144.59-61	144.49-51
T/N								-	▲ 0.077						
S/N								-	-						
1W				▲ 0.058				-	▲ 0.088						
2W		▲ 0.068	▲ 0.005	▲ 0.052				-	▲ 0.097						
3W								-	▲ 0.106						
1M								-	▲ 0.113						
3M				0.000				▲ 0.134	▲ 0.128						
6M								▲ 0.140	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
										日付	6/27	6/28	6/29	6/30	7/3
										日銀当預残	5,518,500	5,497,500	5,494,600	5,444,500	5,426,800
										準備預金残	4,870,000	4,848,500	4,831,600	4,767,200	4,750,000
										マネタリーベース	6,779,500	6,758,900	6,756,300	6,706,100	6,688,100
										無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.076%	▲0.075%	▲0.077%	▲0.071%
										コール市場残高	172,820	173,090	174,678	133,292	168,278
										うち無担	143,641	142,596	144,075	103,868	137,144
										うちO/N	69,541	69,846	73,525	57,643	77,459
										うち有担	29,179	30,494	30,603	29,424	31,134

●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非額格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	371	0.400%	27,000	2023/7/5	2033/6/20	87,865.0	21,834.00	99.7100	0.4300%	16.6381%	99.7300	0.4280%	5,152.0	8.13

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/7/5			6,818	1,001	0.007		0.010	61.8
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/5		0.100	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		2023/7/5		0.290	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/4	2023/7/5	▲0.350	41,250	41,250		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/7/5	2023/7/19	0.000	6,310	6,310				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/4	2023/7/5	▲0.350		53		▲0.350	▲0.350	

*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5日の予定

*7月の日銀当座預金増減要因見込み

*5月の米製造業新規受注・出荷・在庫

◆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たい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