

# Central Daily Market Report

2023年7月7日(金)

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7日 需給速報	2023年7月10日 需給予想	2023年7月11日 当社予想			
銀行券	300	500	▲ 1,000			
財政	▲ 12,800	600	▲ 10,000			
資金過不足	▲ 12,500	1,100	▲ 11,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
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	▲ 39,700	40,000		39,700		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当増増減	▲ 12,400	40,500		▲ 11,000		
当座預金残高	5,363,100	5,403,600		5,392,600		
準備預金残高	4,698,100					
積み終了先	4,697,900			7月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,697,900			積数	400	
非準備預金先	665,000			1日平均	100	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,888,200	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	80.00%		

## ●2023年7月7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、▲0.01%前後での出合いが中心となった。レートが上昇基調となるなか、週末3日積み要因も加わり、一段と上昇する展開となった。しかし出合い一巡後は、ビッドが低下する展開となり、水準を徐々に切り下げながら散発的な出合いとなった。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、▲0.065~▲0.055%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>

7日はTB3M物(第1168回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、やや軟調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2023/7/7	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	前日比	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	▲ 0.012					-	▲ 0.067	0.435	0.030	32,388.42	▲ 384.60	143.96-98	143.22-24		
T/N								-	▲ 0.064								
S/N								-	-								
1W			▲ 0.045					-	▲ 0.076			日銀当預残	5,444,500	5,426,800	5,395,100	5,360,500	5,375,500
2W	▲ 0.015	▲ 0.003	▲ 0.009					-	▲ 0.087			準備預金残	4,767,200	4,750,000	4,706,900	4,694,000	4,704,500
3W			0.060					-	▲ 0.095			マネタリーベース	6,706,100	6,688,100	6,656,300	6,621,500	6,637,200
1M			0.280					-	▲ 0.106			無担O/N加重平均	▲ 0.077%	▲ 0.071%	▲ 0.060%	▲ 0.032%	▲ 0.016%
3M								▲ 0.126	▲ 0.127			コール市場残高	133,292	168,278	158,805	166,781	167,828
6M								▲ 0.200	▲ 0.133			うち無担	103,868	137,144	129,462	135,656	135,584
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102			うちO/N	57,643	77,459	67,407	69,646	67,744
												うち有担	29,424	31,134	29,343	31,125	32,244

## ●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1168	-	58,000	2023/7/10	2023/10/10	156,424.0	47,013.2	100.0305	▲0.1209%	33.1367%	100.0342	▲0.1356%	10,986.0

## ●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		2023/7/10		0.095	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		2023/7/10		0.290	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/7	2023/7/10	▲0.350	39,677	39,677		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/7	2023/7/10	▲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371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10日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)	*5月の米卸売売上高
*5月の国際収支	*5月の米消費者信用残高
*5月の特定サービス産業動態統計速報	
*6月の景気ウオッチャー調査	

◆本資料は信頼できるとさ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