

Central Daily Market Report

2023年7月10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10日 需給速報	2023年7月11日 需給予想	2023年7月12日 当社予想			
銀行券	600	400	▲ 1,000			
財政	3,900	▲ 18,600	▲ 40,000			
資金過不足	4,500	▲ 18,200	▲ 41,000			
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	10,000		19,300	▲ 10,000		▲ 20,000
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			14,100			
CP等買入		▲ 300		▲ 100		
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	▲ 40,400	39,700		40,400		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当増増減	13,500		45,500		▲ 61,000	
当座預金残高	5,376,600		5,422,100		5,361,100	
準備預金残高	4,698,800					
積み終了先	4,698,700			7月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,698,700			積数		300
非準備預金先	677,800			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	83.33%		

●2023年7月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢からの調達を中心に▲0.025~▲0.01%近辺の出会いで始まった。週末要因が剥落したことに加えて、国債買現先オペの実施を受けて、調達目線を引き下げる先が散見された。一巡後はビッドが減少するなか、レート水準もやや低下し、▲0.04~▲0.02%程度で出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出会いが見られず閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%程度での出会いとなった。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。また本日は、2022年3月9日以来となる国債買現先オペ(即日スタート:1兆円、11日スタート:2兆円)が事前通告通り2本オファーされた。

<短国市場>

10日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施され、一部の業態では大型案件も見られた。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

2023/7/10	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.021				-	▲ 0.090	0.465	0.030	32,189.73	▲ 198.69	142.20-22	142.29-30
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.010	▲ 0.046				-	▲ 0.089						
2W							-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.107						
1M							-	▲ 0.117						
3M	0.001	0.030	0.014				▲ 0.135	▲ 0.129						
6M							▲ 0.200	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		7/3	7/4	7/5	7/6	7/7								
日銀当預残	5,426,800	5,395,100	5,360,500	5,375,500	5,363,100									
準備預金残	4,750,000	4,706,900	4,694,000	4,704,500	4,698,100									
マネタリーベース	6,688,100	6,656,300	6,621,500	6,637,200	6,624,400									
無担O/N加重平均	▲ 0.071%	▲ 0.060%	▲ 0.032%	▲ 0.016%	▲ 0.012%									
コール市場残高	168,278	158,805	166,781	167,828	171,731									
うち無担	137,144	129,462	135,656	135,584	139,467									
うちO/N	77,459	67,407	69,646	67,744	70,977									
うち有担	31,134	29,343	31,125	32,244	32,264									

●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
国債買現先・即日	10,000	2023/7/10	2023/7/11		10,471	10,001	▲ 0.100		▲ 0.100	95.5
国債買現先	20,000	2023/7/11	2023/7/12		50,000	20,003	▲ 0.100		▲ 0.092	9.1
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/11		0.065	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		2023/7/11		0.250	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/7/11			12,260	4,252	0.004		0.005	77.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/7/11			10,914	6,755	0.026		0.032	55.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/7/11			3,368	2,001	0.052		0.057	94.1
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/7/11			2,291	1,004	0.056		0.059	77.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/10	2023/7/11	▲ 0.350	40,556	40,556		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/10	2023/7/11	▲ 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11日の予定

*6月のマネーストック	*5年利付国債入札 (25,000億円、7/12発行)	*エネルギー対策借入 (7,800億円、7/20借入)
-------------	--------------------------------	--------------------------------

◆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