

Central Daily Market Report

2023年7月11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11日 需給速報	2023年7月12日 需給予想	2023年7月13日 当社予想			
銀行券	400	600	▲ 500			
財政	▲ 21,900	▲ 51,400	1,000			
資金過不足	▲ 21,500	▲ 50,800	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						
国債買現	19,300	▲ 10,000		▲ 19,300		
国債売現						
国庫短期証券買入			1,000			
国債買入	14,100					
CP等買入		▲ 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				▲ 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	▲ 55,600	40,400		55,600		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当増増減	▲ 13,400	▲ 13,600				500
当座預金残高	5,363,200	5,349,600		5,350,100		
準備預金残高	4,701,600					
積み終了先	4,701,600			7月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,701,600			積数		200
非準備預金先	661,600			1日平均		100
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,888,600
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	86.67%		

●2023年7月11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▲0.03~▲0.02%近辺の出会いで始まった。ビッドサイドの一部に調達目標を引き下げる動きが見られたものの、オファーサイドの運用ニーズがやや減退した事もあり、レートの低下は限定的となった。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.03%近辺で出会いが見られ、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、▲0.08%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。

<短国市場>

11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、無難な結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、入札件数が少なく閑散であった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.002%、平均レート0.011%と、前回(按分0.000%、平均0.014%)比で、按分は上昇し、平均は低下となった。

●短期金融市場関連指標

2023/7/11	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	▲ 0.026					-	▲ 0.088	0.450	▲ 0.015	32,203.57	13.84	141.31-33	140.53-54
T/N								-	▲ 0.086						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.035	▲ 0.052					-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.040	0.030	▲ 0.032					-	▲ 0.096						
3W								-	▲ 0.107						
1M								-	▲ 0.116						
3M								▲ 0.137	▲ 0.129						
6M								▲ 0.200	▲ 0.133						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		7/4	7/5	7/6	7/7	7/10									
日銀当預残	5,395,100	5,360,500	5,375,500	5,363,100	5,376,600										
準備預金残	4,706,900	4,694,000	4,704,500	4,698,100	4,698,200										
マネタリーベース	6,656,300	6,621,500	6,637,200	6,624,400	6,637,300										
無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.032%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.021%										
コール市場残高	158,805	166,781	167,828	171,731	193,834										
うち無担	129,462	135,656	135,584	139,467	161,871										
うちO/N	67,407	69,646	67,744	70,977	95,001										
うち有担	29,343	31,125	32,244	32,264	31,963										

●入札結果

名称	回数	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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	159	0.10%	25,000	2023/7/12	2028/6/20	95,069.0	20,312.0	99,840.0	0.1320%	62.1878%	99,840.0	0.1320%	4,671	10,000
エネルギー対策	-	-	7,800	2023/7/20	2024/7/22	179,400.0	7,799.99		0.0000%	4.3479%		0.0000%		

●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	2023/7/12			7,482	1,001	0.006		0.007	58.4
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/12		0.035	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		2023/7/12		0.200	0	0				
米ドル資金供給		2023/7/13	2023/7/20	5.330	0	0				
CP等買入	4,000	2023/7/14			8,951	3,996	0.002		0.011	37.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/11	2023/7/12	▲0.350	55,931	55,931		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/11	2023/7/12	▲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12日の予定

*6月の企業物価指数	*6月の米消費者物価指数
*5月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+1.0%)	*米ページブック

◆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