

# Central Daily Market Report

2023年7月13日(木)  
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13日 需給速報	2023年7月14日 需給予想	2023年7月18日 当社予想			
銀行券	▲ 800	200	1,000			
財政	2,000	▲ 9,500	9,000			
資金過不足	1,200	▲ 9,300	10,000			
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		38,100				▲ 38,100
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入	▲ 200	4,000	▲ 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			▲ 2,200			
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	▲ 42,000	44,100	42,000			
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	3,100	72,400	▲ 28,100			
当座預金残高	5,308,500	5,380,900	5,352,800			
準備預金残高	4,639,700					
積み終了先	4,639,600			7月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,639,600			積数	100	
非準備預金先	668,800			1日平均	0	
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	100.00%	日数	93.33%		

## ●2023年7月13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▲0.01~▲0.005%近辺の出会いで始まった。積み終盤となり、各業態から着地に向けた資金調達ニーズが増加した事で、レートは上昇した。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.02%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、▲0.085~▲0.075%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、先日付スタートで国債買現先オペ(14日スタート:4兆円)が1本オファーされた。

### <短国市場>

13日のアウトライト市場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発行市場は一部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

2023/7/13	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	▲ 0.009					-	▲ 0.087	0.465	▲ 0.010	32,419.33	475.40	138.30-32	138.36-38
T/N								-	▲ 0.083						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.030	▲ 0.042					-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.050	0.030	▲ 0.023					-	▲ 0.097						
3W								-	▲ 0.108						
1M								-	▲ 0.117						
3M								▲ 0.137	▲ 0.132						
6M								▲ 0.200	▲ 0.133						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		7/6	7/7	7/10	7/11	7/12									
日銀当預残	5,375,500	5,363,100	5,376,600	5,363,200	5,305,400										
準備預金残	4,704,500	4,698,100	4,698,200	4,701,600	4,667,700										
マネタリーベース	6,637,200	6,624,400	6,637,300	6,623,500	6,565,100										
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.012%	▲0.021%	▲0.026%	▲0.019%										
コール市場残高	167,828	171,731	193,834	188,568	196,707										
うち無担	135,584	139,467	161,871	156,697	163,987										
うちO/N	67,744	70,977	95,001	90,127	94,107										
うち有担	32,244	32,264	31,963	31,871	32,720										

## ●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
20年利付国債	185	1.10%	12,000	2023/7/14	2043/6/20	32,849.0	9,712.0	100.4500	1.0720%	72.0597%	100.4900	1.0700%	2,282	
交付税特会	-	-	13,000	2023/7/25	2024/1/25	450,256.0	13,000.56		0.0000%	2.8874%		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
国債買現先	40,000	2023/7/14	2023/7/18		71,350	40,003	▲0.100		▲0.094	34.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/14		0.025	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		2023/7/14		0.180	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/13	2023/7/14	▲0.350	42,335	42,335		▲0.350	▲0.352	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/13	2023/7/14	▲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14日の予定

*7月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(1169回)入札(3ヶ月、58,000億円、7/18発行)
---------------------	---------------------------------------

◆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よう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