

Central Daily Market Report

2023年7月14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14日 需給速報	2023年7月18日 需給予想	2023年7月19日 当社予想	
銀行券	200	300	500	
財政	▲ 9,800	7,800	1,000	
資金過不足	▲ 9,600	8,100	1,500	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出				
全店共通				▲ 6,300
国債買現	38,100		▲ 38,100	
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入		16,700		
CP等買入	4,000	▲ 200	▲ 700	
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		▲ 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	▲ 47,900	42,000	47,900	
※ドル資金供給用担保提供増減				
当増増減	24,200	33,800	▲ 4,800	
当座預金残高	5,332,700	5,366,500	5,361,700	
準備預金残高	4,652,600			
積み終了先	4,652,600		7月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,652,600		積数	107,200
非準備預金先	680,100		1日平均	3,700
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額				4,015,900
準備預金進捗率	実績	97.33%	日数	6.45%

●2023年7月14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▲0.04~▲0.015%近辺の出会いが始まった。積み期間を跨ぐ取引となり、調達量を制限する先も見られたことで、レートは低下した。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.04%近辺で出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085%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>

14日はTB3M物(第1169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、強含んで推移した。

<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、概ね幅広い圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/7/14	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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				-	▲ 0.076	0.475	0.010	32,391.26	▲ 28.07	138.02-03	138.22-24
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.019	▲ 0.034				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.110						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.150	▲ 0.134						
6M							▲ 0.200	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		7/7	7/10	7/11	7/12	7/13								
日銀当預残	5,363,100	5,376,600	5,363,200	5,305,400	5,308,500									
準備預金残	4,698,100	4,698,200	4,701,600	4,667,700	4,640,100									
マネタリーベース	6,624,400	6,637,300	6,623,500	6,565,100	6,569,000									
無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.021%	▲0.026%	▲0.019%	▲0.009%									
コール市場残高	171,731	193,834	188,568	196,707	194,919									
うち無担	139,467	161,871	156,697	163,987	163,490									
うちO/N	70,977	95,001	90,127	94,107	95,760									
うち有担	32,264	31,963	31,871	32,720	31,429									

●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	棄分率	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	1169	-	58,000	2023/7/18	2023/10/16	130,302.0	47,013.5	100.0320	▲0.1297%	18.4219%	100.0337	▲0.1366%	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		2023/7/18		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		2023/7/18		0.200	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/7/18			8,214	4,251	▲0.001		0.000	79.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/7/18			7,433	4,500	0.002		0.007	26.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/7/18			12,863	6,758	0.005		0.012	9.1
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/7/18			1,697	1,000	0.028		0.035	18.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/14	2023/7/18	▲0.350	48,117	48,117		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/14	2023/7/18	▲0.350	57	57		▲0.350	▲0.359	

*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17日の予定

*海の日

●2023年7月18日の予定

*5月の第3次産業活動指数
*5月の石油等消費動態統計
*6月の米小売売上高
*5月の米企業在庫
*6月の米鉱工業生産・設備稼働率

◆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お願いします。
◆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