

Central Daily Market Report

2023年7月19日(水)
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19日 需給速報	2023年7月20日 需給予想	2023年7月21日 当社予想			
銀行券	600	▲ 200	▲ 500			
財政	5,100	4,100	1,000			
資金過不足	5,700	3,900	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	9,000	▲ 6,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入			▲ 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				▲ 300		
気候変動対応オペ						▲ 16,000
E T F買入						
国債補充供給	▲ 41,400	47,000		41,400		
当増減	14,000	44,800	▲ 15,500			
当座預金残高	5,338,000	5,382,800	5,367,300			
準備預金残高	4,651,600					
積み終了先	4,637,100			7月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,635,200			積数	49,700	
非準備預金先	686,400			1日平均	1,800	
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	98.76%	日数	12.90%		

●2023年7月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.06~▲0.045%近辺の出会いが始まった。一巡後も同水準の出会いが続き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、▲0.09~▲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>

19日はTB1Y物(第1170回)の入札が実施され、弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、無難に推移した。

<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

2023/7/19	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	▲ 0.052					-	▲ 0.088	0.460	▲ 0.020	32,896.03	402.14	139.02-04	139.50-52
T/N								-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.009	▲ 0.059					-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.054					-	▲ 0.106						
3W			▲ 0.050					-	▲ 0.111						
1M								-	▲ 0.122						
3M								▲ 0.150	▲ 0.133						
6M								▲ 0.198	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.122	▲ 0.102						
日付		7/11	7/12	7/13	7/14	7/18									
日銀当預残		5,363,200	5,305,400	5,308,500	5,332,700	5,324,000									
準備預金残		4,701,600	4,667,700	4,640,100	4,652,600	4,635,600									
マネタリーベース		6,623,500	6,565,100	6,569,000	6,592,900	6,584,000									
無担O/N加重平均		▲0.026%	▲0.019%	▲0.009%	▲0.021%	▲0.048%									
コール市場残高		188,568	196,707	194,919	174,114	166,773									
うち無担		156,697	163,987	163,490	141,251	136,787									
うちO/N		90,127	94,107	95,760	79,101	73,499									
うち有担		31,871	32,720	31,429	32,863	29,986									

●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)
国庫短期証券	1170	-	35,000	2023/7/20	2024/7/22	76,130.0	28,697.4	100.1120	▲0.1109%	58.5977%	100.1230	▲0.1218%	6,302	
流動性供給	385	-	5,000	2023/7/20	-	21,729.0	4,989.0		▲0.013%	76.7109%		▲0.014%		
交付税特会	-	-	13,000	2023/7/31	2024/1/31	448,529.0	13,000.03		0.0000%	2.8984%		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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/20		0.020	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		2023/7/20		0.180	0	0				
社債等買入	1,000	2023/7/24			2,074	1,002	0.220		0.236	25.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/19	2023/7/20	▲0.350	41,677	41,677		▲0.350	▲0.352	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/19	2023/7/20	▲0.350	38	38		▲0.350	▲0.350	

*オペの種類が、国債補充供給(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20日の予定

*6月の貿易統計	*6月の米中古住宅販売件数
----------	---------------

◆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