

# Central Daily Market Report

2023年7月21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21日 需給速報	2023年7月24日 需給予想	2023年7月25日 当社予想			
銀行券	▲ 100	300	▲ 500			
財政	▲ 1,900	8,300	11,000			
資金過不足	▲ 2,000	8,600	10,500			
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						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	17,600					
CP等買入		▲ 400		▲ 400		
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	1,000	▲ 100		
気候変動対応オペ	34,400	▲ 16,000				
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 40,100	40,800		40,100		
当増減	34,200	49,200	10,500			
当座預金残高	5,375,300	5,424,500	5,435,000			
準備預金残高	4,682,500					
積み終了先	4,680,300			7月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,678,200			積数	26,700	
非準備預金先	692,800			1日平均	1,200	
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	99.34%	日数	25.81%		

## ●2023年7月21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▲0.085~▲0.065%近辺の出会いが始まった。3日積みであるものの調達ニーズに変化はなく、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、▲0.095~▲0.09%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>

21日はTB3M物(第1171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、五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施され、一部の業態では大型発行も見られた。発行レートは概ね楕円圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/7/21	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	▲ 0.070					-	▲ 0.093	0.475	0.017	32,304.25	▲ 186.27	139.81-84	141.36-38
T/N								-	▲ 0.096						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.055	▲ 0.071					-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.003					-	▲ 0.106						
3W								-	▲ 0.113						
1M								-	▲ 0.122						
3M								▲ 0.119	▲ 0.132						
6M								▲ 0.198	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.122	▲ 0.102						
日付	7/13	7/14	7/18	7/19	7/20										
日銀当預残	5,308,500	5,332,700	5,324,000	5,338,000	5,341,100										
準備預金残	4,640,100	4,652,600	4,635,600	4,651,900	4,646,000										
マネタリーベース	6,569,000	6,592,900	6,584,000	6,597,400	6,600,700										
無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.021%	▲ 0.048%	▲ 0.052%	▲ 0.061%										
コール市場残高	194,919	174,114	166,773	180,590	177,661										
うち無担	163,490	141,251	136,787	150,935	147,371										
うちO/N	95,760	79,101	73,499	83,347	78,983										
うち有担	31,429	32,863	29,986	29,655	30,290										

## ●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非償債競争入札(億円)
国庫短期証券	1171	-	58,000	2023/7/24	2023/10/23	109,325.0	47,013.8	100.0260	▲0.1042%	86.5555%	100.0302	▲0.1210%	10,986.0
流動性供給	386	-	5,000	2023/7/24	-	21,175.0	4,998.00	-	0.0110%	8.1818%	-	0.0050%	-

## ●オペ結果

種類	オフター額(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		2023/7/24		0.042	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		2023/7/24		0.222	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2023/7/21	2023/7/24	▲0.350	40,362	40,362		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2023/7/21	2023/7/24	▲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ター。※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ター。

## ●2023年7月24日の予定

\*特にありません

◆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論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