

Central Daily Market Report

2023年7月24日(月)
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24日 需給速報	2023年7月25日 需給予想	2023年7月26日 当社予想			
銀行券	300	▲ 100	1,000			
財政	8,100	12,700	▲ 7,000			
資金過不足	8,400	12,600	▲ 6,000			
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						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 400	▲ 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	1,000	▲ 100	▲ 400			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 40,900	40,100	40,900			
当預増減	8,100	53,000	▲ 6,000			
当座預金残高	5,383,400	5,436,400	5,430,400			
準備預金残高	4,689,400					
積み終了先	4,687,300			7月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,687,300			積数	24,600	
非準備預金先	694,000			1日平均	1,100	
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	99.39%	日数	29.03%		

●2023年7月24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~▲0.060%近辺の出合いが始まった。ビッドサイドの調達ニーズが弱く、前週に引き続きギブン地合いとなった。一巡後も同水準の出合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見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%程度での出合いとなった。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>

24日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、小口の発行案件が中心となるなか、一部業態からは中規模の発行も実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/7/24	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	
	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	▲ 0.073				-	▲ 0.095	0.455	▲ 0.020	32,700.94	396.69	141.72-74	141.41-44
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.045	▲ 0.066				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.075	▲ 0.055	▲ 0.069				-	▲ 0.110						
3W			▲ 0.065				-	▲ 0.115						
1M			0.011				-	▲ 0.119						
3M			0.030				▲ 0.119	▲ 0.130						
6M							▲ 0.198	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.122	▲ 0.102						
									日付	7/14	7/18	7/19	7/20	7/21
									日銀当預残	5,332,700	5,324,000	5,338,000	5,341,100	5,375,300
									準備預金残	4,652,600	4,635,600	4,651,900	4,646,000	4,682,800
									マネタリーベース	6,592,900	6,584,000	6,597,400	6,600,700	6,635,000
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.048%	▲0.052%	▲0.061%	▲0.070%
									コール市場残高	174,114	166,773	180,590	177,661	184,491
									うち無担	141,251	136,787	150,935	147,371	153,523
									うちO/N	79,101	73,499	83,347	78,983	83,440
									うち有担	32,863	29,986	29,655	30,290	30,968

●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	募入最高利回り	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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		2023/7/25		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		2023/7/25		0.215	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/24	2023/7/25	▲0.350	41,154	41,154		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/24	2023/7/25	▲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25日の予定

*米FOMC(1日目)	*40年利付国債入札(7,000億円、7/26発行)
*5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*交付税特別会計借入(12,000億円、8/4借入)
*7月の米CB消費者信頼感指数	

◆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