

Central Daily Market Report

2023年7月25日(火)
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25日 需給速報	2023年7月26日 需給予想	2023年7月27日 当社予想	
銀行券	▲ 100	▲ 100	▲ 1,000	
財政	13,900	▲ 6,500	2,000	
資金過不足	13,800	▲ 6,600	1,000	
金融調節	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		1,000		
国債買入				
CP等買入		▲ 100	▲ 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		▲ 400	▲ 100	
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 40,300	40,900	40,300	
当増減	13,900	34,400	1,000	
当座預金残高	5,397,300	5,431,700	5,432,700	
準備預金残高	4,695,200			
積み終了先	4,693,200		7月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,693,100		積数	22,500
非準備預金先	702,100		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	99.44%	日数	32.26%

●2023年7月25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%近辺の出合いが始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで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、▲0.10~▲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>

25日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2023/7/25	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	▲ 0.074				-	▲ 0.093	0.460	0.005	32,682.51	▲ 18.43	141.53-55	141.38-40		
T/N							-	▲ 0.097								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.075	▲ 0.055	▲ 0.071				-	▲ 0.106			日付	7/18	7/19	7/20	7/21	7/24
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.109			日銀当預残	5,324,000	5,338,000	5,341,100	5,375,300	5,383,400
3W			▲ 0.075				-	▲ 0.115			準備預金残	4,635,600	4,651,900	4,646,000	4,682,800	4,689,400
1M							-	▲ 0.118			マネタリーベース	6,584,000	6,597,400	6,600,700	6,635,000	6,642,800
3M							▲ 0.119	▲ 0.129			無担O/N加重平均	▲ 0.048%	▲ 0.052%	▲ 0.061%	▲ 0.070%	▲ 0.073%
6M							▲ 0.198	▲ 0.134			コール市場残高	166,773	180,590	177,661	184,491	186,452
1Y							▲ 0.122	▲ 0.102			うち無担	136,787	150,935	147,371	153,523	155,303
											うちO/N	73,499	83,347	78,983	83,440	81,320
											うち有担	29,986	29,655	30,290	30,968	31,149

●入札結果

名称	回数	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)
40年利付国債	16	1.30%	7,000	2023/7/26	2063/3/20	17,786.0	6,999.0	95.0500	1.4650%	7.8431%				
交付税特会	-	-	12,000	2023/8/4	2024/2/5	430,458.0	12,000.06		0.0000%	2.7878%		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
国庫短期証券買入	1,000	2023/7/26			9,090	1,000	0.018		0.019	97.8
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/26		0.045	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		2023/7/26		0.251	0	0				
米ドル資金供給		2023/7/27	2023/8/3	5.540	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/25	2023/7/26	▲0.350	40,480	40,480		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/25	2023/7/26	▲0.350	29	29		▲0.350	▲0.360	

*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26日の予定

*月例経済報告	*米FOMC(2日目)
*6月の企業向けサービス価格指数	*6月の米新築一戸建て販売件数
*5月の景気動向指数改訂状況	

◆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