

Central Daily Market Report

2023年7月26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26日 需給速報	2023年7月27日 需給予想	2023年7月28日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 900	500			
財政	▲ 5,500	▲ 2,500	900			
資金過不足	▲ 5,700	▲ 3,400	1,400			
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	1,000					
国債買入		15,000				
CP等買入		▲ 200	▲ 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	▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 41,200	40,300	41,200			
当預増減	▲ 5,900	52,300	1,400			
当座預金残高	5,391,400	5,443,700	5,445,100			
準備預金残高	4,692,800					
積み終了先	4,690,700			7月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,690,700			積数	20,300	
非準備預金先	698,600			1日平均	1,000	
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	99.49%	日数	35.48%		

●2023年7月26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>

26日のアウトライト市場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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。
また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート0.000%、平均落札レート0.005%と、前回(按分0.002%、平均0.011%)比で、按分、平均ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2023/7/26	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	売買参考統計値	前日比	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					-	▲ 0.093	0.444	▲ 0.016	32,668.34	▲ 14.17	140.90-92	140.64-66
T/N								-	▲ 0.097						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.045					-	▲ 0.105						
2W			▲ 0.072					-	▲ 0.110						
3W	▲ 0.075	▲ 0.020	▲ 0.048					-	▲ 0.113						
1M								-	▲ 0.118						
3M			0.027					▲ 0.119	▲ 0.129						
6M								▲ 0.198	▲ 0.134						
1Y								▲ 0.122	▲ 0.102						
										日付	7/19	7/20	7/21	7/24	7/25
										日銀当預残	5,338,000	5,341,100	5,375,300	5,383,400	5,397,300
										準備預金残	4,651,900	4,646,000	4,682,800	4,689,400	4,695,300
										マネタリーベース	6,597,400	6,600,700	6,635,000	6,642,800	6,656,800
										無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.061%	▲0.070%	▲0.073%	▲0.074%
										コール市場残高	180,590	177,661	184,491	186,452	178,921
										うち無担	150,935	147,371	153,523	155,303	147,873
										うちO/N	83,347	78,983	83,440	81,320	71,740
										うち有担	29,655	30,290	30,968	31,149	31,048

●入札結果

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		2023/7/27		0.040	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		2023/7/27		0.250	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/7/27			9,874	4,506	0.005		0.006	53.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/7/27			10,571	6,756	0.001		0.004	47.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/7/27			2,820	2,002	0.005		0.009	9.2
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/7/27			1,962	1,003	0.008		0.011	4.7
国債買入(物価連動債)	600	2023/7/27			2,407	600		▲0.430	▲0.430	
CP等買入	4,000	2023/7/31			9,596	3,986	0.000		0.005	68.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/26	2023/7/27	▲0.350	41,464	41,464		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/26	2023/7/27	▲0.350	0	0				

*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27日の予定

*日銀金融政策決定会合 (1日目、28日まで)	*ECB定例理事会(金融政策発表) *4-6月期の米GDP速報値 *6月の米耐久財新規受注	*国庫短期証券(1172回)入札(3ヶ月、58,000億円、7/31発行) *2年利付国債入札(29,000億円、8/1発行) *交付税特別会計借入(12,000億円、8/8借入)
----------------------------	---	--

◆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