

Central Daily Market Report

2023年7月27日(木)
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27日 需給速報	2023年7月28日 需給予想	2023年7月31日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 400	1,100			
財政	▲ 2,200	9,800	10,000			
資金過不足	▲ 3,100	9,400	11,100			
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	15,000					
CP等買入		▲ 400	▲ 200	4,000		
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						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 45,100	41,200	45,100			
※下は資金供給用担保関係債						
当預増減	7,500	54,200	15,100			
当座預金残高	5,398,900	5,453,100	5,468,200			
準備預金残高	4,693,200					
積み終了先	4,691,300			7月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,691,300			積数	18,400	
非準備預金先	705,700			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	99.54%	日数	38.71%		

●2023年7月27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。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>

27日はTB3M物(第1172回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施され、大型案件も散見された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/7/27	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	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	▲ 0.071					-	▲ 0.093	0.435	▲ 0.009	32,891.16	222.82	140.37-38	139.98-00
T/N			▲ 0.060					-	▲ 0.097						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.065					-	▲ 0.107						
2W	▲ 0.045	▲ 0.015	▲ 0.033					-	▲ 0.107						
3W								-	▲ 0.114						
1M	▲ 0.015	0.180	0.009					-	▲ 0.118						
3M	0.001	0.020	0.014					▲ 0.105	▲ 0.128						
6M								▲ 0.175	▲ 0.135						
1Y								▲ 0.120	▲ 0.102						
										日付	7/20	7/21	7/24	7/25	7/26
										日銀当預残	5,341,100	5,375,300	5,383,400	5,397,300	5,391,400
										準備預金残	4,646,000	4,682,800	4,689,400	4,695,300	4,692,800
										マネタリーベース	6,600,700	6,635,000	6,642,800	6,656,800	6,651,000
										無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.070%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.073%
										コール市場残高	177,661	184,491	186,452	178,921	179,868
										うち無担	147,371	153,523	155,303	147,873	148,124
										うちO/N	78,983	83,440	81,320	71,740	69,686
										うち有担	30,290	30,968	31,149	31,048	31,744

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1172	-	58,000	2023/7/31	2023/10/30	128,258.8	47,233.7	100.0240	▲0.0962%	60.2032%	100.0254	▲0.01018%	10,766.0
2年利付国債	451	0.01%	29,000	2023/8/1	2025/8/1	93,129.0	23,579.0	100.0950	▲0.0420%	66.5866%	100.1010	▲0.0450%	5,412.0
交付税特会	-	-	12,000	2023/8/8	2024/2/8	428,670.0	12,000.6		0.0000%	2.7995%		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)	授分レート・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	授分比率
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/7/28		0.056	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		2023/7/28		0.270	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/27	2023/7/28	▲0.350	45,262	45,254		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/27	2023/7/28	▲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28日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*6月の米個人所得・消費支出(PCE)
*植田日銀総裁定例会見 *経済・物価情勢の展望	
*7月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.9%)	

◆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