

Central Daily Market Report

2023年7月31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31日 需給速報	2023年8月1日 需給予想	2023年8月2日 当社予想			
銀行券	600	100	500			
財政	15,500	▲ 26,300	▲ 78,000			
資金過不足	16,100	▲ 26,200	▲ 77,500			
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						▲ 9,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入		1,000				
国債買入	8,400	3,200				
CP等買入	4,000	▲ 1,800				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
債権等買入						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 50,900	46,600	50,900			
当預増減	22,400	28,900	▲ 86,500			
当座預金残高	5,428,100	5,457,000	5,370,500			
準備預金残高	4,728,800					
積み終了先	4,727,400			8月1日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,727,400			積数	11,900	
非準備預金先	699,300			1日平均	800	
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	99.70%	日数	51.61%		

●2023年7月31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▲0.07~▲0.055%近辺の出会いが始まった。一巡後も同水準の出会いが続き本日の取引を終えた。月末であったが前営業日比で概ね横ばいからやや低下した程度での推移となった。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>

31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、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/7/31	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	▲ 0.061					-	▲ 0.093	0.600	0.055	33,172.22	412.99	140.73-76	142.17-18
T/N								-	▲ 0.096						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.045	▲ 0.047					-	▲ 0.106						
2W								-	▲ 0.111						
3W								-	▲ 0.114						
1M	▲ 0.010	▲ 0.004	▲ 0.006					-	▲ 0.119						
3M								▲ 0.105	▲ 0.128						
6M								▲ 0.175	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.120	▲ 0.101						
日付	7/24	7/25	7/26	7/27	7/28										
日銀当預残	5,383,400	5,397,300	5,391,400	5,398,900	5,405,700										
準備預金残	4,689,400	4,695,300	4,692,800	4,693,200	4,699,800										
マネタリーベース	6,642,800	6,656,800	6,651,000	6,659,500	6,666,700										
無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.074%	▲0.073%	▲0.071%	▲0.059%										
コール市場残高	186,452	178,921	179,868	194,086	189,503										
うち無担	155,303	147,873	148,124	163,002	158,099										
うちO/N	81,320	71,740	69,686	87,164	85,411										
うち有担	31,149	31,048	31,744	31,084	31,404										

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/8/1			9,743	1,002	0.009		0.010	85.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/8/1		0.455	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		2023/8/1		0.670	0	0				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/8/1			8,724	3,002	0.039		0.043	50.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/31	2023/8/1	▲0.350	51,301	51,301		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/31	2023/8/1	▲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31回の買入利回りは、1.000%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、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2023年8月1日の予定

*6月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*7月のISM製造業景況指数	*10年利付国債入札(27,000億円、8/2発行)
*6月の有効求人倍率(市場予想:1.32倍)	*6月の米建設支出	

◆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