

Central Daily Market Report

2023年7月5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5日 需給速報	2023年7月6日 需給予想	2023年7月7日 当社予想			
銀行券	200	▲ 700	▲ 300			
財政	▲ 32,400	2,800	▲ 6,000			
資金過不足	▲ 32,200	2,100	▲ 6,300			
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	6,300	▲ 8,900				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			12,400			
CP等買入		▲ 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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 41,900	41,300		41,900		
※ドル資金供給用担保債提供						
当増増減	▲ 34,600	56,400	▲ 6,300			
当座預金残高	5,360,500	5,416,900	5,410,600			
準備預金残高	4,694,000					
積み終了先	4,693,800			7月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,693,800			積数	1,300	
非準備預金先	666,500			1日平均	100	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,883,300	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	66.67%		

●2023年7月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.04~▲0.03%程度での出合いが中心となり、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られた。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.075~▲0.065%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>

5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発行市場は複数の発行が観測され、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

2023/7/5	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	▲ 0.032					-	▲ 0.074	0.380	▲ 0.015	33,338.70	▲ 83.82	144.39-42	144.43-46
T/N								-	▲ 0.077						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.033					-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.050	▲ 0.049	▲ 0.050					-	▲ 0.096						
3W								-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.032					-	▲ 0.113						
3M								▲ 0.134	▲ 0.130						
6M								▲ 0.140	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
日付	6/28	6/29	6/30	7/3	7/4										
日銀当預残	5,497,500	5,494,600	5,444,500	5,426,800	5,395,100										
準備預金残	4,848,500	4,831,600	4,767,200	4,750,000	4,706,900										
マネタリーベース	6,758,900	6,756,300	6,706,100	6,688,100	6,656,300										
無担O/N加重平均	▲0.076%	▲0.075%	▲0.077%	▲0.071%	▲0.060%										
コール市場残高	173,090	174,678	133,292	168,278	158,805										
うち無担	142,596	144,075	103,868	137,144	129,462										
うちO/N	69,846	73,525	57,643	77,459	67,407										
うち有担	30,494	30,603	29,424	31,134	29,343										

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	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		2023/7/6		0.105	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		2023/7/6		0.306	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/7/6			6,255	1,504	0.004		0.006	58.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/7/6			12,439	4,251	0.003		0.004	41.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/7/6			9,962	4,508	0.001		0.003	23.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/7/6			4,628	2,004	▲0.007		▲0.004	21.0
米ドル資金供給		2023/7/7	2023/7/13	5.330	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/5	2023/7/6	▲0.350	41,837	41,837		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/5	2023/7/6	▲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 1日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 2日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6日の予定

*5月の米貿易収支	*国庫短期証券(1167回)入札(6ヶ月、40,000億円、7/10発行)
*6月のISM非製造業景況指数	*30年利付国債入札(9,000億円、7/7発行)
	*交付税特別会計借入(13,000億円、7/18借入)

◆本資料は信頼できるとさ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