

# Central Daily Market Report

2023年7月12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12日 需給速報	2023年7月13日 需給予想	2023年7月14日 当社予想			
銀行券	600	▲ 700	▲ 500			
財政	▲ 51,500	3,100	▲ 12,000			
資金過不足	▲ 50,900	2,400	▲ 12,500			
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						
国債買現		▲ 19,300				
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
CP等買入			▲ 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				
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	▲ 44,100	55,600	44,100			
※1日平均資金供給用担保提供総額						
当増減	▲ 57,800	46,300	▲ 8,500			
当座預金残高	5,305,400	5,351,700	5,343,200			
準備預金残高	4,667,700					
積み終了先	4,667,600			7月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,667,600			積数	200	
非準備預金先	637,700			1日平均	100	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,888,600	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	90.00%		

## ●2023年7月12日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢からの調達を中心に▲0.025~▲0.015%近辺の出会いが始まった。積み終盤となり、着地に向けた資金調達ニーズも見られたことで、レートは上昇した。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.03%近辺で出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出会いは見られず閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.04%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>

12日のアウトライイト市場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、複数の業態で大型発行が実施された。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

2023/7/12	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	▲ 0.019				-	▲ 0.076	0.475	0.025	31,943.93	▲ 259.64	140.10-12	139.55-57
T/N							-	▲ 0.066						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.039				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.137	▲ 0.131						
6M							▲ 0.200	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付	7/5	7/6	7/7	7/10	7/11									
日銀当預残	5,360,500	5,375,500	5,363,100	5,376,600	5,363,200									
準備預金残	4,694,000	4,704,500	4,698,100	4,698,200	4,701,600									
マネタリーベース	6,621,500	6,637,200	6,624,400	6,637,300	6,623,500									
無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.021%	▲0.026%									
コール市場残高	166,781	167,828	171,731	193,834	188,568									
うち無担	135,656	135,584	139,467	161,871	156,697									
うちO/N	69,646	67,744	70,977	95,001	90,127									
うち有担	31,125	32,244	32,264	31,963	31,871									

## ●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	案分率	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		2023/7/13		0.050	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		2023/7/13		0.220	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/12	2023/7/13	▲0.350	44,178	44,178		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/12	2023/7/13	▲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13日の予定

*6月の米生産者物価指数	*20年利付国債入札 (12,000億円、7/14発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、7/25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よう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