

Central Daily Market Report

2023年7月18日(火)
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18日 需給速報	2023年7月19日 需給予想	2023年7月20日 当社予想			
銀行券	200	500	▲ 500			
財政	12,400	9,400	▲ 6,000			
資金過不足	12,600	9,900	▲ 6,500			
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	▲ 6,300		
国債買現		▲ 38,100				
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	16,700					
CP等買入		▲ 700				
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				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 47,000	47,900		47,000		
当増減	▲ 8,700	59,600	▲ 6,500			
当座預金残高	5,324,000	5,383,600	5,377,100			
準備預金残高	4,635,600					
積み終了先	4,618,000			7月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,594,500			積数	66,100	
非準備預金先	688,400			1日平均	2,400	
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	98.35%	日数	9.68%		

●2023年7月18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▲0.055~▲0.04%近辺の出会いが始まった。積み初日となった事から、ビッドサイドに慎重な姿勢が見られ、レートは低下した。一巡後は▲0.06%近辺で出会いが見られ、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、▲0.09~▲0.08%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>

18日のアウトラ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、五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施された。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

2023/7/18	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	▲ 0.048				-	▲ 0.087	0.480	0.005	32,493.89	102.63	138.70-72	138.22-24		
T/N							-	▲ 0.090								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.058	▲ 0.040	▲ 0.051				-	▲ 0.096			5,376,600	5,363,200	5,305,400	5,308,500	5,332,700	
2W	▲ 0.060	▲ 0.010	▲ 0.040				-	▲ 0.103			4,698,200	4,701,600	4,667,700	4,640,100	4,652,600	
3W							-	▲ 0.109			6,637,300	6,623,500	6,565,100	6,569,000	6,592,900	
1M	▲ 0.055	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.120			6,637,300	6,623,500	6,565,100	6,569,000	6,592,900	
3M							▲ 0.150	▲ 0.133			▲ 0.021%	▲ 0.026%	▲ 0.019%	▲ 0.009%	▲ 0.021%	
6M							▲ 0.200	▲ 0.135			193,834	188,568	196,707	194,919	174,114	
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102			うち無担	161,871	156,697	163,987	163,490	141,251
											うちO/N	95,001	90,127	94,107	95,760	79,101
											うち有担	31,963	31,871	32,720	31,429	32,863

●入札結果

名称	回数	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		2023/7/19		0.025	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		2023/7/19		0.175	0	0				
米ドル資金供給		2023/7/20	2023/7/27	5.330	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/18	2023/7/19	▲0.350	47,403	47,403		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/7/19	2023/8/2	0.000	8,970	8,970				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/18	2023/7/19	▲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19日の予定

*6月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1170回)入札	*流動性供給入札	*交付税特別会計借入
*6月のユーロ圏消費者物価指数改定値	(1年、35,000億円、7/20発行)	(5,000億円、7/20発行)	(13,000億円、7/31借入)
*6月の英消費者物価指数			

◆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