

Central Daily Market Report

2023年7月20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20日 需給速報	2023年7月21日 需給予想	2023年7月24日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 200	1,000			
財政	3,200	▲ 1,300	12,000			
資金過不足	3,000	▲ 1,500	13,000			
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		17,600				
CP等買入	▲ 200	▲ 400				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	▲ 300	▲ 100	1,000			
気候変動対応オペ		34,400	▲ 16,000			
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 40,800	41,400	40,800			
当増減	3,100	74,800	14,000			
当座預金残高	5,341,100	5,415,900	5,429,900			
準備預金残高	4,646,000					
積み終了先	4,638,200			7月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,636,100			積数	39,800	
非準備預金先	695,100			1日平均	1,500	
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	99.01%	日数	16.13%		

●2023年7月20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~▲0.05%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。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>

20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、一部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。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

2023/7/20	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					-	▲ 0.086	0.458	▲ 0.002	32,490.52	▲ 405.51	139.60-62	139.62-63
T/N								-	▲ 0.093						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.059	▲ 0.064					-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.059	▲ 0.005	▲ 0.033					-	▲ 0.104						
3W								-	▲ 0.111						
1M			▲ 0.055					-	▲ 0.119						
3M			0.480					▲ 0.150	▲ 0.133						
6M								▲ 0.198	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.122	▲ 0.102						
日付	7/12	7/13	7/14	7/18	7/19										
日銀当預残	5,305,400	5,308,500	5,332,700	5,324,000	5,338,000										
準備預金残	4,667,700	4,640,100	4,652,600	4,635,600	4,651,900										
マネタリーベース	6,565,100	6,569,000	6,592,900	6,584,000	6,597,400										
無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.009%	▲0.021%	▲0.048%	▲0.052%										
コール市場残高	196,707	194,919	174,114	166,773	180,590										
うち無担	163,987	163,490	141,251	136,787	150,935										
うちO/N	94,107	95,760	79,101	73,499	83,347										
うち有担	32,720	31,429	32,863	29,986	29,655										

●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		2023/7/21		0.040	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		2023/7/21		0.220	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/7/21			8,104	4,255	▲0.003		▲0.002	68.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/7/21			10,302	4,505	▲0.007		▲0.005	6.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/7/21			12,668	6,753	▲0.011		▲0.006	19.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/7/21			3,632	2,003	▲0.017		▲0.014	39.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/7/20	2023/7/21	▲0.350	41,084	41,084		▲0.350	▲0.352	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/7/20	2023/7/21	▲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。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
気候変動対応支援オペ	2023/7/21	2024/7/19	0	34,398

●2023年7月21日の予定

*6月の全国消費者物価指数(CPI)

(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.3%)

*国庫短期証券(1171回)入札

(3ヶ月、58,000億円、7/24発行)

*流動性供給入札

(5,000億円、7/24発行)

◆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