Central Daily Market Report

2026年7月2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	2026年7月2日 需給速報	2026年7月3日 需給予想	2026年7月6日 当社予想
銀行券	▲ 400	200	500
財政	▲ 34,600	▲ 23,100	3,500
資金過不足	▲ 35,000	▲ 22,900	4,000

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						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 400	900		400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 34,500		▲ 22,500		4,000	

当座預金残高	4,348,600	4,326,100	4,330,100
準備預金残高	4,021,000		
積み終了先	4,021,000	7月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,021,000	積数	400
非準備預金先	327,600	1日平均	0
積み期間（6/16～7/15日）の所要準備額（積数）			4,080,800
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数 56.67%

●2026年7月2日の市場動向

<無担保コール市場>
本日の無担保コールO/N物は、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られ、0.977～0.978%程度で推移した。
ターム物では、ショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>
GC T/Nは、1.00～1.005%前後の出合いとなった。
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>
2日のアウトライト市場は、3M物、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>
CP市場は、大型発行を含め複数の業態で発行が観測された。
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

7/2	無担保コール（速報）				短国		東京レポレート	
単位：%	最低	最高	平均		売買参考統計値		平均値	
O/N	0.950	1.030	0.977	1W	1.030	1.050	1.041	
T/N				2W				
S/N				3W				
2日				1M	1.030	1.060	1.042	
3日				2M				
4日				3M			1.220	
5日				4M				
6日			1.100	5M				
有担保コール（速報）				6M				
翌日物			0.930	1Y				

T+0	0.998				
T+1	1.000				
1W	1.000				
2W	1.000				
3W	1.000				
1M	1.001				
3M	1.008	3M	0.920		
6M	1.056	6M	0.990		
1Y	1.160	1Y	1.175		

JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替（ドル/円）	
直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
2.780	+0.080	68,733.15	▲ 1,741.81	162.54-56	161.43-44

日付	6/25	6/26	6/29	6/30	7/1
日銀当預残	4,403,900	4,400,000	4,404,100	4,404,100	4,383,100
準備預金残	4,099,300	4,097,000	4,094,700	4,072,400	4,055,700
マネタリーベース	5,599,900	5,596,400	5,600,200	5,600,300	5,579,600
無担O/N加重平均	0.978%	0.977%	0.978%	0.976%	0.977%
コール市場残高	117,118	118,559	118,984	110,193	124,495
うち無担	92,182	94,243	94,979	86,997	99,063
うちO/N	34,237	34,097	35,333	31,666	38,537
うち有担	24,936	24,316	24,005	23,196	25,432

●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第Ⅰ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	383	2.7%	26,000	2026/7/3	2036/6/20	61,448	19,631	99.57	2.755%	91.4461%	99.77	2.729%	6,353	14.24

●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（%）	利回り（%）※1	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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/7/2	2026/7/3		0.750	431	431		0.750	0.750	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/7/2	2026/7/3		0.750	0	0				

●2026年7月3日の予定

*7月の日銀当座預金増減要因見込み　*New York 祝日(Independence Day Observed)　*国庫短期証券(第1391回)入札（3か月、38,000億円、7/6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論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