

Central Daily Market Report

2026年7月3日(金)

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3日 需給速報	2026年7月6日 需給予想	2026年7月7日 当社予想			
銀行券	300	400	0			
財政	▲ 21,500	17,400	6,500			
資金過不足	▲ 21,200	17,800	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						
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			▲ 100			
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 900	400	900			
当預増減	▲ 21,700	18,600	6,500			
当座預金残高	4,326,900	4,345,500	4,352,000			
準備預金残高	4,004,000					
積み終了先	4,004,000			7月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,004,000			積数	200	
非準備預金先	322,900			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	100.00%	日数	66.67%		

●2026年7月3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、週末3日積みとなったが、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、幅広い期間で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、1.00~1.01%前後の出会いとなった。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>

3日は、TDB3M物(第1391回)の入札が実施され、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでは軟調に推移した。

<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

7/3	無担保コール(速報)							短国		東京レポレート		JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)	
	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	終値	前日比	9時	17時			
O/N	0.950	0.979	0.977	1W	0.981	1.060	1.001	T+0	1.000	2.770	▲ 0.010	69,744.07	+1,010.92	161.44-46	160.77-79		
T/N				2W	1.070	1.150	1.110	T+1	1.000								
S/N				3W													
2日				1M	1.040	1.060	1.050	1W	1.000								
3日			0.976	2M				2W	1.000								
4日				3M	1.200	1.250	1.219	3W	1.000								
5日				4M				1M	1.001								
6日				5M				3M	1.008								
有担保コール(速報)				6M				6M	1.056								
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.161								
日付				6/26	6/29	6/30	7/1	7/2	日銀当預残		4,400,000	4,404,100	4,404,100	4,383,100	4,348,600		
準備預金残				4,097,000	4,094,700	4,072,400	4,055,700	4,021,000	準備預金残		4,097,000	4,094,700	4,072,400	4,055,700	4,021,000		
マネタリーベース				5,596,400	5,600,200	5,600,300	5,579,600	5,545,500	無担O/N加重平均		0.977%	0.978%	0.976%	0.977%	0.977%		
無担O/N加重平均				0.977%	0.978%	0.976%	0.977%	0.977%	コール市場残高		118,559	118,984	110,193	124,495	121,710		
うち無担				94,243	94,979	86,997	99,063	97,317	うちO/N		34,097	35,333	31,666	38,537	36,276		
うち有担				24,316	24,005	23,196	25,432	24,393	うち有担		24,316	24,005	23,196	25,432	24,393		

●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償額募入札(億円)	非償額募入札(億円)
国庫短期証券	1391	-	38,000	2026/7/6	2026/10/5	97,817	29,192.8	99.7685	0.9306%	29.9509%	99.7728	0.9133%	8,807	

●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)		2026/7/3	2026/7/6		0.750	1,005	1,005		0.750	0.750	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/7/3	2026/7/6		0.750	0	0				

●2026年7月6日の予定

*6月の米ISM非製造業景況指数

◆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