

Central Daily Market Report

2026年7月6日(月)
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6日 需給速報	2026年7月7日 需給予想	2026年7月8日 当社予想
銀行券	400	400	0
財政	17,700	10,900	▲ 4,000
資金過不足	18,100	11,300	▲ 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			4,600			
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						
国債補充供給	▲ 1,300	900		1,300		
※下引資金供給用担保国債供給						
当預増減	17,600		17,200		▲ 4,000	

当座預金残高	4,344,500	4,361,700	4,357,700	
準備預金残高	4,009,400			
積み終了先	4,009,400		7月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,009,400		積数	100
非準備預金先	335,100		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	70.00%

●2026年7月6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、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>

6日のアウトライト市場は、3M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、複数の発行が観測され、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

7/6	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	0.978	0.977	1W				T+0	1.000	2.830	+0.060	69,737.69	▲ 6.38	161.46-48	162.16-17	
T/N				2W				T+1	1.000							
S/N			0.976	3W												
2日				1M	1.050	1.260		1W	1.000							
3日				2M				2W	1.000							
4日				3M				3W	1.000							
5日				4M				1M	1.002							
6日				5M				3M	1.008							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.057							
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.162							

日付	6/29	6/30	7/1	7/2	7/3
日銀当預残	4,404,100	4,404,100	4,383,100	4,348,600	4,326,900
準備預金残	4,094,700	4,072,400	4,055,700	4,021,000	4,004,000
マネタリーベース	5,600,200	5,600,300	5,579,600	5,545,500	5,523,400
無担O/N加重平均	0.978%	0.976%	0.977%	0.977%	0.977%
コール市場残高	118,984	110,193	124,495	121,710	121,853
うち無担	94,979	86,997	99,063	97,317	96,682
うちO/N	35,333	31,666	38,537	36,276	36,171
うち有担	24,005	23,196	25,432	24,393	25,171

●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I非価格競争入札(億円)	第I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(%)	利回り(%)※1	応募総額(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(残存期間1年以下)	1,000	2026/7/7				3,382	1,003	0.000		0.029	3.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,350	2026/7/7				8,931	3,353	0.027		0.027	81.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2026/7/7				2,976	1,002	0.037		0.039	31.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/7/6	2026/7/7	0.750	1.418	1,418		0.750	0.750		
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/7/6	2026/7/7	0.750	9	9		0.750	0.750		

●2026年7月7日の予定

*5月の全世帯家計調査	*5月の米貿易収支	*30年利付国債入札(6,000億円、7/8発行)
*5月の毎月勤労統計調査速報	*5月の米消費者信用残高	*交付税特会借入(12,000億円、7/17発行)
*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引		
*5月の景気動向指数速報		

◆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