

Central Daily Market Report

2026年7月7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	2026年7月7日 需給速報	2026年7月8日 需給予想	2026年7月9日 当社予想			
銀行券	400	0	0			
財政	9,300	▲ 3,500	▲ 1,000			
資金過不足	9,700	▲ 3,500	▲ 1,000			
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			8,000	▲ 8,000		
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						
気候変動対応オペ						
国債補充供給	▲ 1,600	1,300		1,600		
※下ろし資金供給用担保国債供給						
当預増減	14,000	▲ 1,900	▲ 1,000			
当座預金残高	4,358,500	4,356,600	4,355,600			
準備預金残高	4,022,700					
積み終了先	4,022,700			7月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,022,700			積数	100	
非準備預金先	335,800			1日平均	0	
積み期間(6/16~7/15日)の所要準備額(積数)					4,062,000	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	73.33%		

●2026年7月7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、1.005%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>

7日のアウトライト市場は、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。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

7/7	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	1.030	0.978	1W	0.981	1.110	1.029	T+0	1.000	2.841	+0.011	68,256.96	▲ 1,480.73	162.09-11	161.96-97		
T/N				2W				T+1	1.000								
S/N				3W													
2日				1M				1W	1.000								
3日				2M				2W	1.000								
4日				3M				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	1.057								
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.175								
								日付		6/30	7/1	7/2	7/3	7/6			
								日銀当預残		4,404,100	4,383,100	4,348,600	4,326,900	4,326,900			
								準備預金残		4,072,400	4,055,700	4,021,000	4,004,000	4,004,000			
								マネタリーベース		5,600,300	5,579,600	5,545,500	5,523,400	5,523,400			
								無担O/N加重平均		0.976%	0.977%	0.977%	0.977%	0.977%			
								コール市場残高		110,193	124,495	121,710	121,853	121,853			
								うち無担		86,997	99,063	97,317	96,682	96,682			
								うちO/N		31,666	38,537	36,276	36,171	36,171			
								うち有担		23,196	25,432	24,393	25,171	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・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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	91	4.0%	6,000	2026/7/8	2056/6/20	20,700	4,549	100.05	3.996%	84.2484%	100.09	3.993%	1,448	
交付税特会	-	-	12,000	2026/7/17	2027/1/15	54,228	12,000		1.160%	88.5980%		1.148%		

●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
米ドル資金供給		2026/7/9	2026/7/16	3.880		2	2				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/7/7	2026/7/8		0.750	1,679	1,679		0.750	0.750	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2026/7/8	2026/7/22	1.000		18,490	8,009				43.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/7/7	2026/7/8		0.750	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2026/7/8	2026/7/17		0.970	3	3		0.970	0.970	

※1. オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)、米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り、国債買現先の場合は、下限期間利回り、国債買入の場合は、下限利回較差、国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。

●2026年7月8日の予定

*5月の国際収支	*5月の米卸売売上高	*国庫短期証券(第1392回)入札(6か月、35,000億円、7/10発行)
*6月の景気ウォッチャー調査		

◆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