

Central Daily Market Report

2026年7月9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9日 需給速報	2026年7月10日 需給予想	2026年7月13日 当社予想			
銀行券	▲ 200	300	500			
財政	14,800	▲ 19,900	▲ 5,000			
資金過不足	14,600	▲ 19,600	▲ 4,500			
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			▲ 500			
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 1,500	1,100	1,500			
※以下は資金供給用担保国債供給						
当預増減	14,200	▲ 18,600	▲ 4,500			
当座預金残高	4,365,700	4,347,100	4,342,600			
準備預金残高	4,029,100					
積み終了先	4,029,100		7月10日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,029,100		積数	0		
非準備預金先	336,600		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	80.00%		

●2026年7月9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>

9日のアウトライト市場は、3M、6M、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

複数の業態で大型発行が実施され、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

7/9	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				T+0	1.000	2.875	+0.010	67,743.85	+924.80	162.52-53	162.34-36	
T/N				2W				T+1	1.000							
S/N				3W												
2日				1M				1W	1.000							
3日				2M	1.060	1.155	1.123	2W	1.000							
4日				3M	1.210	1.225	1.220	3W	1.000							
5日				4M				1M	1.001							
6日				5M				3M	1.008							
有担保コール(速報)				6M			1.490	6M	1.057							
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.163							
											日付	7/2	7/3	7/6	7/7	7/8
											日銀当預残	4,348,600	4,326,900	4,326,900	4,358,500	4,351,500
											準備預金残	4,021,000	4,004,000	4,004,000	4,022,700	4,006,600
											マネタリーベース	5,545,500	5,523,400	5,523,400	5,554,200	5,547,200
											無担O/N加重平均	0.977%	0.977%	0.977%	0.978%	0.978%
											コール市場残高	121,710	121,853	121,853	121,914	123,558
											うち無担	97,317	96,682	96,682	97,169	98,178
											うちO/N	36,276	36,171	36,171	35,318	34,490
											うち有担	24,393	25,171	25,171	24,745	25,380

●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)
5年利付国債	186	2.0%	25,000	2026/7/10	2031/6/20	65,424	19,059	99.88	2.026%	58.0908%	99.91	2.020%	5,933	1.40
エネルギー対策	-	-	8,088	2026/7/21	2027/7/20	37,913	8,088		1.358%	72.1954%		1.342%		

●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)		2026/7/9	2026/7/10		0.750	2,011	2,011		0.750	0.750	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/7/9	2026/7/10		0.750	4	4		0.750	0.750	

※1. オペの種類が、国債補完供給(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10日の予定

*6月の企業物価指数	*国庫短期証券(第1393回)入札 (3か月、38,000億円、7/13発行)
------------	--

◆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