Central Daily Market Report

2026年7月17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17日 需給速報		2026年7月21日 需給予想		2026年7月22日 当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 600		0	
財政	200		19,100		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 200		18,500		▲ 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
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		▲ 100		
気候変動対応オペ			139,800	▲ 101,600		
国債補完供給	▲ 1,100	400		1,100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,000		57,700		▲ 9,000	

当座預金残高	4,316,600	4,374,300	4,365,300
準備預金残高	3,983,800		
積み終了先	3,966,900	7月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,684,300	積数	53,200
非準備預金先	332,800	1日平均	2,000
積み期間（7/16～8/15日）の所要準備額（積数）			4,195,400
準備預金進捗率	実績 98.73%	日数	16.13%

●2026年7月17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、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%程度の出合いとなった。
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>
17日はTDB3M物（第1395回）の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅くに推移した。

<CP市場>
CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。
発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

7/17	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		最低	最高	平均	売買参考統計値		平均値	
O/N	0.950	0.979	0.977	1W	0.983	1.055	1.024			T+0	1.000
T/N				2W			1.085			T+1	1.000
S/N			0.975	3W			1.100				
2日				1M	0.990	1.100	1.018			1W	1.000
3日				2M						2W	1.000
4日				3M	1.210	1.285	1.260			3W	1.000
5日				4M			1.340			1M	1.000
6日			1.100	5M				3M	0.960	3M	1.009
有担保コール（速報）				6M				6M	1.029	6M	1.058
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.190	1Y	1.165

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
2.705	▲ 0.005	64,141.12	▲ 2,694.42	162.36-38	162.28-29

日付	7/10	7/13	7/14	7/15	7/16
日銀当預残	4,347,600	4,328,100	4,316,000	4,306,700	4,317,600
準備預金残	4,015,100	3,998,500	3,989,100	3,981,800	3,986,000
マネタリーベース	5,543,100	5,523,200	5,510,900	5,501,600	5,513,000
無担O/N加重平均	0.977%	0.977%	0.977%	0.981%	0.979%
コール市場残高	122,252	122,710	124,138	125,720	125,491
うち無担	97,378	98,133	100,281	101,688	101,720
うちO/N	33,530	33,805	34,828	36,045	36,917
うち有担	24,874	24,577	23,857	24,032	23,771

●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)
国庫短期証券	1395	－	38,000	2026/7/21	2026/10/19	115,723	28,978.6	99.7615	0.9695%	30.3121%	99.7634	0.9618%	9,021	

●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）		2026/7/17	2026/7/21		0.500	1,371	1,371		0.500	0.500	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/7/17	2026/7/21		0.500	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率(%)	貸付予定総額（億円）
気候変動対応支援オペ	2026/7/21	2027/7/21	1.0	139,812

●2026年7月20日の予定

*海の日　　*1-3月期のユーロ圏GDP確報値

●2026年7月21日の予定

特段予定はございません

◆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