

●資金需給

単位：億円	2026年7月27日 需給速報	2026年7月28日 需給予想	2026年7月29日 当社予想
銀行券	100	400	0
財政	10,700	1,200	▲ 6,500
資金過不足	10,800	1,600	▲ 6,500
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出	スタート	エンド	スタート
全店共通	スタート	エンド	スタート
国債買現	スタート	エンド	スタート
国債売現	スタート	エンド	スタート
国庫短期証買入	スタート	エンド	スタート
国債買入	スタート	エンド	スタート
貸出支援基金(貸)	スタート	エンド	スタート
被災地支援	スタート	エンド	スタート
社債等買入	▲ 100	▲ 300	
気候変動対応オペ			
国債補完供給			
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	10,700	1,300	▲ 6,500
当座預金残高	4,404,400	4,405,700	4,399,200
準備預金残高	4,066,700		
積み終了先	4,065,500	7月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,065,500	積数	5,500
非準備預金先	337,700	1日平均	300
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	99.87%	日数
			38.71%

●2026年7月27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、ショートタームを中心に引き合いがみられた。

＜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＞
27日のアウトライト市場は、3M物と1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数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

7/27	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)	
単位: %	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	0.985	1.055	1.008		T+0	0.994	2.770	▲ 0.044	64,931.19	+320.04	163.61-63	163.52-53	
T/N				2W			1.150		T+1	1.000							
S/N				3W													
2日			1.050	1M					1W	1.000							
3日			1.045	2M					2W	1.000							
4日			0.970	3M			1.250		3W	1.000							
5日				4M					1M	1.000							
6日				5M				3M	1.000								
有担保コール(速報)				6M				6M	1.080	6M	1.081						
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.250	1Y	1.210						
JGB新発10年債(%)																	
日経平均株価(円)																	
為替(ドル/円)																	
日付																	
7/17																	
7/21																	
7/22																	
7/23																	
7/24																	
日銀当預残												4,316,600	4,366,800	4,363,700	4,378,300	4,393,700	
準備預金残												3,983,800	4,032,900	4,032,300	4,043,900	4,059,900	
マネタリーベース												5,512,400	5,563,300	5,559,700	5,574,400	5,589,900	
無担O/N加重平均												0.977%	0.977%	0.978%	0.980%	0.977%	
コール市場残高												125,112	127,349	129,149	126,076	122,862	
うち無担												100,893	102,832	104,817	102,036	99,310	
うちO/N												35,639	36,278	37,113	35,342	33,196	
うち有担												24,219	24,517	24,332	24,040	23,552	

●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)
交付税特会	-	-	12,000	2026/8/5	2027/2/3	51,824	12,000		1.181%	54.2525%		1.174%		-

●オペ結果

種類	オフター額(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(午前オフター分)		2026/7/27	2026/7/28		0.500	48	48		0.500	0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2026/7/27	2026/7/28		0.500	0	0				

※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28日の予定

*米FOMC(1日目)	*流動性供給(6,500億円、7/29発行)
*7月の米CB消費者信頼感指数	
*5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	

◆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