

# Central Daily Market Report

2026年6月1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6月1日 需給速報	2026年6月2日 需給予想	2026年6月3日 当社予想			
銀行券	700	800	500			
財政	▲ 55,500	▲ 47,700	▲ 30,000			
資金過不足	▲ 54,800	▲ 46,900	▲ 29,500			
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(成)						▲ 3,100
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	▲ 1,200		1,200			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 56,100	▲ 45,700	▲ 32,600			
当座預金残高	4,465,200	4,419,500	4,386,900			
準備預金残高	4,157,500					
積み終了先	4,156,700			6月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,156,700			積数	2,300	
非準備預金先	307,700			1日平均	200	
積み期間(5/16~6/15日)の所要準備額(積数)					4,197,500	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	54.84%		

## ●2026年6月1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、出合いの水準は0.727~0.728%程度で推移した。ターム物は、幅広い期間で引き合いが見られた。

### <レボ市場>

GC T/Nは、0.755~0.76%前後の出合いとなった。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>

1日のアウトライイト市場は、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の発行が観測された。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

6/1 単位: %	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	0.700	0.728	0.726	1W		0.735		T+0	0.752	2.680	+0.025	66,934.33	+604.83	159.36-38	159.46-47	
T/N				2W		0.773		T+1	0.755							
S/N				3W												
2日			0.725	1M		0.925		1W	0.751							
3日				2M				2W	0.751							
4日				3M	1.050	1.080	1.068	3W	0.782							
5日				4M			1.185	1M	0.843							
6日				5M				3M	0.931							
有担保コール(速報)				6M				6M	0.955							
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.116							
											日付	5/25	5/26	5/27	5/28	5/29
											日銀当預残	4,519,100	4,523,800	4,521,700	4,522,700	4,521,300
											準備預金残	4,198,000	4,210,400	4,216,900	4,220,700	4,216,400
											マネタリーベース	5,718,400	5,722,600	5,720,500	5,721,100	5,719,100
											無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%
											コール市場残高	112,842	111,355	110,651	116,746	107,799
											うち無担	87,248	86,841	87,168	92,465	84,240
											うちO/N	31,329	31,502	30,399	35,216	30,311
											うち有担	25,594	24,514	23,483	24,281	23,559

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/6/1	2026/6/2		0.550	1,363	1,363		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/6/1	2026/6/2		0.550	0	0				

## ●2026年6月2日の予定

*1-3月期の法人企業統計調査	*5月のユーロ圏消費者物価指数速報値	*10年利付国債入札(26,000億円、6/3発行)
*5月のマネタリーベース		
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み		

◆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よう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