Central Daily Market Report

2026年6月2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6月2日 需給速報	2026年6月3日 需給予想	2026年6月4日 当社予想
銀行券	800	▲ 100	100
財政	▲ 62,100	▲ 28,800	2,000
資金過不足	▲ 61,300	▲ 28,900	2,100

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）				▲ 2,600		
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	▲ 400	1,200		400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 60,500		▲ 31,600		2,100	

当座預金残高	4,404,700	4,373,100	4,375,200
準備預金残高	4,101,600		
積み終了先	4,100,900	6月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,100,900	積数	1,500
非準備預金先	303,100	1日平均	100
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 99.96%	日数	58.06%

●2026年6月2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。

<レポ市場>
GC T/Nは、0.75～0.76%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>
2日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>
CP発行市場は、複数業態から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

6/2	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	0.700	0.780	0.727	1W	0.734	0.830	0.754		T+0	0.751
T/N				2W					T+1	0.755
S/N				3W						
2日				1M					1W	0.752
3日				2M					2W	0.752
4日				3M	1.080	1.120	1.107		3W	0.791
5日				4M					1M	0.855
6日				5M				3M 0.900	3M	0.933
有担保コール（速報）				6M				6M 0.955	6M	0.976
翌日物			0.680	1Y				1Y 1.100	1Y	1.118

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
2.565	▲ 0.115	66,734.24	▲ 200.09	159.64-65	159.68-69

日付	5/26	5/27	5/28	5/29	6/1
日銀当預残	4,523,800	4,521,700	4,522,700	4,521,300	4,465,200
準備預金残	4,210,400	4,216,900	4,220,700	4,216,400	4,155,800
マネタリーベース	5,722,600	5,720,500	5,721,100	5,719,100	5,662,300
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.726%
コール市場残高	111,355	110,651	116,746	107,799	113,205
うち無担	86,841	87,168	92,465	84,240	88,587
うちO/N	31,502	30,399	35,216	30,311	33,203
うち有担	24,514	23,483	24,281	23,559	24,618

●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)
10年利付国債	382	2.4%	26,000	2026/6/3	2036/3/20	70,031	19,839	98.01	2.656%	88.2646%	98.06	2.649%	6,151	2.37

●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		2026/6/4	2026/6/11	3.870		0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/6/2	2026/6/3		0.550	414	414		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/2	2026/6/3		0.550	47	47		0.550	0.550	

●2026年6月3日の予定

*植田日銀総裁 きさらぎ会における講演
*6月の日銀当座預金増減要因見込み
*5月のISM非製造業景況指数
*4月の米製造業新規受注・出荷・在庫
*米ベージュブック

◆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