Central Daily Market Report

2026年6月3日（水）
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3日 需給速報		2026年6月4日 需給予想		2026年6月5日 当社予想	
銀行券	▲ 100		600		500	
財政	▲ 37,000		6,400		4,000	
資金過不足	▲ 37,100		7,000		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			4,400			
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	▲ 600	400		600		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 40,400		12,000		4,500	
当座預金残高	4,364,300		4,376,300		4,380,800	
準備預金残高	4,071,000					
積み終了先	4,070,200					
超過準備	4,070,200					
非準備預金先	293,300					

6月4日以降の残り所要積立額	
積数	700
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	99.98%　日数 61.29%

●2026年6月3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、0.755～0.76%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>
3日のアウトライト市場は、3M物で出合いが見られた。

<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

6/3	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	0.732	0.860	0.798			T+0	0.751
T/N				2W						T+1	0.755
S/N				3W							
2日				1M						1W	0.752
3日				2M			1.040			2W	0.752
4日			0.850	3M	1.100	1.310	1.178			3W	0.797
5日				4M						1M	0.866
6日				5M				3M	0.905	3M	0.942
有担保コール（速報）				6M				6M	0.964	6M	0.977
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.100	1Y	1.124

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
2.640	+0.075	68,402.13	+1,667.89	159.97-99	159.70-71

日付	5/27	5/28	5/29	6/1	6/2
日銀当預残	4,521,700	4,522,700	4,521,300	4,465,200	4,404,700
準備預金残	4,216,900	4,220,700	4,216,400	4,155,800	4,101,600
マネタリーベース	5,720,500	5,721,100	5,719,100	5,662,300	5,601,000
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.726%	0.727%
コール市場残高	110,651	116,746	107,799	113,205	114,072
うち無担	87,168	92,465	84,240	88,587	90,719
うちO/N	30,399	35,216	30,311	33,203	33,925
うち有担	23,483	24,281	23,559	24,618	23,353

●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
国債買入（残存期間1年以下）	1,000	2026/6/4				5,049	1,001	0.025		0.028	28.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	2,300	2026/6/4				5,947	2,301	0.040		0.042	38.0
国債買入（残存期間10年超25年以下）	800	2026/6/4				4,423	801	0.033		0.034	72.0
国債買入（残存期間25年超）	750	2026/6/4				1,345	753	0.001		0.017	56.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/6/3	2026/6/4		0.550	666	666		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/3	2026/6/4		0.550	0	0				

●2026年6月4日の予定

*流動性供給入札
（2,500億円、6/5発行）

*交付税特別会計借入
（11,000億円、6/12借入）

◆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