Central Daily Market Report

2026年6月4日（木）
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4日 需給速報	2026年6月5日 需給予想	2026年6月8日 当社予想
銀行券	700	900	200
財政	5,000	2,500	4,500
資金過不足	5,700	3,400	4,700

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）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 300		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 1,400	600		1,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	9,300		4,500		4,700	

当座預金残高	4,373,600	4,378,100	4,382,800
準備預金残高	4,073,400		
積み終了先	4,072,900	6月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,072,900	積数	200
非準備預金先	300,200	1日平均	0
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 100.00%	日数	64.52%

●2026年6月4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>
4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、複数業態の発行が散見された。
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

6/4	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		売買参考統計値		平均値	
O/N	0.700	0.728	0.726	1W	0.732	0.805	0.757	T+0	0.751
T/N				2W	0.825	0.910	0.868	T+1	0.755
S/N				3W					
2日				1M	1.000	1.180	1.090	1W	0.752
3日				2M	1.030	1.065	1.048	2W	0.769
4日				3M			1.100	3W	0.822
5日				4M				1M	0.889
6日				5M				3M	0.951
有担保コール（速報）				6M				6M	0.982
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.132

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
2.669	+0.029	67,470.69	▲ 931.44	159.94-96	159.89-91

日付	5/28	5/29	6/1	6/2	6/3
日銀当預残	4,522,700	4,521,300	4,465,200	4,404,700	4,364,300
準備預金残	4,220,700	4,216,400	4,155,800	4,101,600	4,071,000
マネタリーベース	5,721,100	5,719,100	5,662,300	5,601,000	5,560,700
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.726%	0.727%	0.727%
コール市場残高	116,746	107,799	113,205	114,072	115,497
うち無担	92,465	84,240	88,587	90,719	92,187
うちO/N	35,216	30,311	33,203	33,925	34,683
うち有担	24,281	23,559	24,618	23,353	23,310

●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)
流動性供給	455	－	2,500	2026/6/5	－	6,650	2,498		0.005%	7.3863%		▲0.006%		
交付税特会	－	－	11,000	2026/6/12	2026/12/11	49,508	11,000		1.105%	99.5320%		1.089%		－

●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）		2026/6/4	2026/6/5		0.550	1,486	1,486		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/4	2026/6/5		0.550	0	0				

●2026年6月5日の予定

*4月の全世帯家計調査
*4月の毎月勤労統計調査速報
*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*4月の景気動向指数速報
*5月の米雇用統計
*4月の米消費者信用残高
*1-3月期のユーロ圏GDP確報値
*国庫短期証券(第1385回)入札
（3か月、41,000億円、6/8発行）

◆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