

Central Daily Market Report

2026年6月11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11日 需給速報	2026年6月12日 需給予想	2026年6月15日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 200	▲ 600			
財政	▲ 15,100	21,200	77,000			
資金過不足	▲ 15,300	21,000	76,400			
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			7,500			
貸出支援基金(成)						
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						
国債補完供給	▲ 1,700	900		1,700		
当増減	▲ 16,100	30,100				76,400
当座預金残高	4,348,800	4,378,900				4,455,300
準備預金残高	4,044,700					
積み終了先	4,044,700				6月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,044,700				積数	0
非準備預金先	304,100				1日平均	0
積み期間(5/16~6/15日)の所要準備額(積数)						4,212,200
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数			87.10%

●2026年6月11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た。出会いの水準は、0.725~0.728%程度で推移した。ターム物は、ショートタームでの引き合いが見受けられた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.75~0.76%前後の出会いとなった。SCI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>

11日のアウトライト市場は、3M物と6M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

6/11	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	0.727	1W				T+0	0.751	2.680	0.000	64,217.27	+38.00	160.52-54	160.50-51	
T/N				2W				T+1	0.753							
S/N				3W												
2日				1M	1.020	1.140	1.078	1W	0.804							
3日				2M				2W	0.898							
4日				3M	1.150	1.160	1.153	3W	0.930							
5日			0.850	4M				1M	0.953							
6日				5M				3M	0.978							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.000							
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.142							

●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非償債募入札(億円)	非償債入札(億円)
エネルギー対策	-	-	7,315	2026/6/22	2027/6/21	29,988	7,315		1.328%	21.0000%		1.302%		

●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年超3年以下)	2,550	2026/6/12				7,591	2,551	0.001		0.003	12.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,300	2026/6/12				5,304	2,305	▲0.008		▲0.005	21.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	2,400	2026/6/12				5,340	2,402	▲0.002		▲0.001	79.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	800	2026/6/12				2,684	806	0.018		0.019	84.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/6/11	2026/6/12	0.550		1,908	1,908		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/6/11	2026/6/12	0.550		0	0				

●2026年6月12日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(4月27、28日分)	*6月のミンガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(第1387回)入札(3か月、41,000億円、6/15発行)
--------------------------	---------------------	--

◆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