

Central Daily Market Report

2026年6月12日(金)
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12日 需給速報	2026年6月15日 需給予想	2026年6月16日 当社予想			
銀行券	▲ 100	400	400			
財政	20,100	78,000	4,000			
資金過不足	20,000	78,400	4,400			
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	▲ 200			
気候変動対応オペ						
国債補充供給	▲ 2,900	1,700	2,900			
*ドル資金供給用担保国債供給						
当増減	26,200	81,100	4,400			
当座預金残高	4,375,000	4,456,100	4,460,500			
準備預金残高	4,065,600					
積み終了先	4,065,600			6月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,065,600			積数	0	
非準備預金先	309,400			1日平均	0	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)					4,211,700	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.77%		

●2026年6月12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、週末3日積みを迎えたが、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ことから、出合いの水準は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。
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>

12日はTDB3M物(第1387回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。
この他、6M物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数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

6/12 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	0.729	0.727	1W					T+0	0.752	2.635	▲ 0.045	66,020.04	+1,802.77	160.13-15	160.27-29
T/N				2W	1.010	1.040	1.024		T+1	0.755						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.903						
3日				2M					2W	0.937						
4日				3M			1.180		3W	0.956						
5日				4M					1M	0.975						
6日				5M					3M	0.983						
有担保コール(速報)				6M					6M	1.015						
翌日物			0.680	1Y					1Y	1.145						
日付		6/5	6/8	6/9	6/10	6/11	日銀当預残		4,374,100	4,375,900	4,376,200	4,364,900	4,348,800			
準備預金残		4,073,900	4,076,000	4,066,100	4,061,200	4,044,700	マネタリーベース		5,568,900	5,569,800	5,569,400	5,558,200	5,542,200			
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		115,440	114,910	115,806	116,171	116,826			
うち無担		91,299	91,198	92,046	91,845	92,756	うちO/N		34,315	32,964	33,162	32,291	33,752			
うち有担		24,141	23,712	23,760	24,326	24,070										

●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1387	-	41,000	2026/6/15	2026/9/14	112,460	31,293.7	99,7665	0.9387%	76.1157%	99.7688	0.9294%	9,706	

●オペ結果

種類	オフア額(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(午前オフア一分)		2026/6/12	2026/6/15		0.550	2,772	2,772		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア一分)		2026/6/12	2026/6/15		0.550	367	367		0.550	0.550	

●2026年6月15日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目) *5月の米鉱工業生産・設備稼働率
*4月の第3次産業活動指数

◆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