

Central Daily Market Report

2026年6月15日(月)
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15日 需給速報	2026年6月16日 需給予想	2026年6月17日 当社予想			
銀行券	300	300	200			
財政	79,600	700	4,500			
資金過不足	79,900	1,000	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						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200	▲ 200			
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 4,000	2,900	4,000			
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	78,600	4,800	4,700			
当座預金残高	4,453,600	4,458,400	4,463,100			
準備預金残高	4,141,700					
積み終了先	4,141,700			6月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,141,700			積数	4,080,800	
非準備預金先	311,900			1日平均	136,000	
積み期間(6/16~7/15日)の所要準備額(積数)					4,080,800	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2026年6月15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ことで0.727~0.728%程度で推移した。ターム物では、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>

15日のアウトライト市場は、6M物と1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数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

6/15 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	0.775	0.727	1W				T+0	0.751	2.575	▲ 0.060	69,317.50	+3,297.46	159.95-97	160.12-13	
T/N				2W				T+1	0.755							
S/N				3W												
2日				1M				1W	0.949							
3日				2M				2W	0.968							
4日				3M				3W	0.975							
5日				4M				1M	0.987							
6日				5M				3M	0.993							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.020							
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.142							

日付	6/8	6/9	6/10	6/11	6/12
日銀当預残	4,375,900	4,376,200	4,364,900	4,348,800	4,375,000
準備預金残	4,076,000	4,066,100	4,061,200	4,044,700	4,065,600
マネタリーベース	5,569,800	5,569,400	5,558,200	5,542,200	5,568,600
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	114,910	115,806	116,171	116,826	116,419
うち無担	91,198	92,046	91,845	92,756	92,409
うちO/N	32,964	33,162	32,291	33,752	33,155
うち有担	23,712	23,760	24,326	24,070	24,010

●入札結果

名称	回数	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II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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/6/15	2026/6/16		0.550	2,871	2,871		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/6/15	2026/6/16		0.550	1,400	1,400		0.550	0.550	

●2026年6月16日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目)	*米FOMC(1日目)
*日銀総裁定例会見	*5月の米住宅着工件数

◆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