Central Daily Market Report

2026年6月17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17日 需給速報		2026年6月18日 需給予想		2026年6月19日 当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 400		700	
財政	18,600		6,900		3,600	
資金過不足	18,000		6,500		4,300	
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）				▲ 70,200		▲ 46,265
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 2,400	2,500		2,400		
＊ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	18,100		▲ 61,300		▲ 41,965	
当座預金残高	4,470,200		4,408,900		4,366,935	
準備預金残高	4,164,700					
積み終了先	3,915,000		6月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,359,000		積数	198,500		
非準備預金先	305,500		1日平均	7,100		
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	95.14%	日数	6.67%		

●2026年6月17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、前日の日銀金融政策決定会合における政策金利の引き上げを受け、0.977～0.978%程度となった。
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、1.005%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>
17日のアウトライト市場は、6M物と1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>
CP発行市場は、複数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

6/17	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	0.950	1.030	0.978	1W	0.981	1.090	1.000	T+0	0.991
T/N				2W			1.100	T+1	0.999
S/N				3W			1.220		
2日				1M	1.050	1.230	1.106	1W	1.000
3日				2M				2W	1.000
4日				3M				3W	1.000
5日				4M				1M	1.000
6日				5M			1.375	3M	0.875	3M	1.000
有担保コール（速報）				6M				6M	1.020	6M	1.028
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.145	1Y	1.151

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
2.600	▲ 0.045	69,902.25	+497.75	160.42-43	160.18-20

日付	6/10	6/11	6/12	6/15	6/16
日銀当預残	4,364,900	4,348,800	4,375,000	4,453,600	4,452,100
準備預金残	4,061,200	4,044,700	4,065,600	4,141,500	4,134,700
マネタリーベース	5,558,200	5,542,200	5,568,600	5,647,000	5,645,200
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	116,171	116,826	116,419	120,998	115,827
うち無担	91,845	92,756	92,409	95,733	91,330
うちO/N	32,291	33,752	33,155	35,969	33,806
うち有担	24,326	24,070	24,010	25,265	24,497

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/6/17	2026/6/18		0.750	2,823	2,823		0.750	0.750	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/17	2026/6/18		0.750	0	0				

●2026年6月18日の予定

＊英中銀MPC

＊国庫短期証券(第1388回)入札
（1年、28,000億円、6/22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