

Central Daily Market Report

2026年6月18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18日 需給速報	2026年6月19日 需給予想	2026年6月22日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 200	▲ 500			
財政	3,500	100	57,900			
資金過不足	3,000	▲ 100	57,400			
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		7,700				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	▲ 70,200	▲ 24,100				
被災地支援						
社債等買入			▲ 400			
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 2,200	2,400	2,200			
*ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 67,000	▲ 14,700	57,400			
当座預金残高	4,403,200	4,388,500	4,445,900			
準備預金残高	4,101,700					
積み終了先	4,043,800			6月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,994,000			積数	90,800	
非準備預金先	301,500			1日平均	3,400	
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	97.77%	日数	10.00%		

●2026年6月18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、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、0.977~0.978%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、1.005%前後の出会いとなった。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>

18日はTDB1Y物(第1388回)の入札が実施され、無難な結果となった。セカンドリーでは、堅調に推移した。この他、3M物でも出会いが見られた。

<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

6/18 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	0.950	0.978	0.977	1W				T+0	0.998	2.615	+0.015	71,053.49	+1,151.24	160.59-61	160.59-60	
T/N				2W				T+1	1.000							
S/N				3W												
2日				1M	1.080	1.090	1.085	1W	1.000							
3日				2M			1.100	2W	1.000							
4日				3M	1.180	1.200	1.193	3W	1.000							
5日				4M			1.300	1M	1.000							
6日				5M			1.350	3M	1.001							
有担保コール(速報)				6M				6M	1.031							
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.151							
											日付	6/11	6/12	6/15	6/16	6/17
											日銀当預残	4,348,800	4,375,000	4,453,600	4,452,100	4,470,200
											準備預金残	4,044,700	4,065,600	4,141,500	4,134,700	4,164,700
											マネタリーベース	5,542,200	5,568,600	5,647,000	5,645,200	5,663,900
											無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.978%
											コール市場残高	116,826	116,419	120,998	115,827	112,844
											うち無担	92,756	92,409	95,733	91,330	88,097
											うちO/N	33,752	33,155	35,969	33,806	33,252
											うち有担	24,070	24,010	25,265	24,497	24,747

●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非償還額(億円)	非償還額(億円)
国庫短期証券	1388	-	28,000	2026/6/22	2027/6/21	71,785	21,355.7	98.852	1.1645%	57.4700%	98.858	1.1583%	6,644	

●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	2026/6/19				7,037	2,552	0.006		0.010	7.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,300	2026/6/19				5,226	2,301	0.004		0.006	15.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	2,400	2026/6/19				4,302	2,404	0.021		0.025	43.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	800	2026/6/19				2,718	803	0.024		0.026	29.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/6/18	2026/6/19		0.750	2,460	2,460		0.750	0.750	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/6/18	2026/6/19		0.750	0	0				

●2026年6月19日の予定

*5月の全国消費者物価指数	*New York祝日(Juneteenth National Independence Day)	*国庫短期証券(第1389回)入札(3か月、41,000億円、6/22発行)
*金融政策決定会合議事要旨(4月27、28日分)		*流動性供給入札(6,500億円、6/22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