Central Daily Market Report

2026年6月19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19日 需給速報	2026年6月22日 需給予想	2026年6月23日 当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 300	700
財政	0	50,700	▲ 5,000
資金過不足	▲ 100	50,400	▲ 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	7,700					
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）		▲ 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	▲ 1,200	2,200		1,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 15,900		51,600		▲ 4,300	

当座預金残高	4,387,300	4,438,900	4,434,600
準備預金残高	4,071,800		
積み終了先	4,063,400		
超過準備	4,052,400		
非準備預金先	315,500		

6月22日以降の残り所要積立額	
積数	32,400
1日平均	1,300

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	99.21%	日数 20.00%

●2026年6月19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日積みとなったが、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、1.000～1.005%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>
19日はTDB3M物（第1389回）の入札が実施され、事前予想対比で強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。このほか、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>
CP発行市場は、一部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

6/19	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		最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	
O/N	0.950	0.978	0.977	1W					T+0	1.001
T/N				2W					T+1	1.002
S/N				3W						
2日			0.976	1M					1W	1.000
3日				2M					2W	1.000
4日				3M			1.170		3W	1.000
5日				4M					1M	1.000
6日				5M				3M	0.900	3M	1.002
有担保コール（速報）				6M				6M	1.000	6M	1.036
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.160	1Y	1.153

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
2.645	+0.030	71,250.06	+196.57	161.29-31	161.31-33

日付	6/12	6/15	6/16	6/17	6/18
日銀当預残	4,375,000	4,453,600	4,452,100	4,470,200	4,403,200
準備預金残	4,065,600	4,141,500	4,134,700	4,164,700	4,101,700
マネタリーベース	5,568,600	5,647,000	5,645,200	5,663,900	5,597,300
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.978%	0.977%
コール市場残高	116,419	120,998	115,827	112,844	112,691
うち無担	92,409	95,733	91,330	88,097	87,896
うちO/N	33,155	35,969	33,806	33,252	32,581
うち有担	24,010	25,265	24,497	24,747	24,795

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1389	－	41,000	2026/6/22	2026/9/24	96,375	31,503.8	99.7630	0.9224%	79.2411%	99.7660	0.9107%	9,496	
流動性供給	456	－	6,500	2026/6/22	－	18,978	6,489		0.020%	98.6666%		0.016%		

●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）		2026/6/19	2026/6/22		0.750	1,330	1,330		0.750	0.750	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/19	2026/6/22		0.750	0	0				

●2026年6月22日の予定

特段予定はございません

◆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