Central Daily Market Report

2026年6月26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26日 需給速報	2026年6月29日 需給予想	2026年6月30日 当社予想
銀行券	▲ 400	200	400
財政	▲ 6,800	3,400	4,500
資金過不足	▲ 7,200	3,600	4,900

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			5,600			
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 800	4,100		800		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 3,900		10,000		4,900	

当座預金残高	4,400,000	4,410,000	4,414,900
準備預金残高	4,097,000		
積み終了先	4,095,700	6月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,095,300	積数	3,400
非準備預金先	303,000	1日平均	200
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	99.92%	日数	43.33%

●2026年6月26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、1.00～1.005%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>
26日に実施された3M物入札は引き続き政策金利対比で強い水準で決着し、結果発表後のセカンダリーでは底堅く推移した。
この他、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>
CP市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。
発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

6/26	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	0.995	1.150	1.031		T+0	1.000
T/N				2W			1.120		T+1	1.000
S/N				3W						
2日				1M	1.100	1.175	1.109		1W	1.000
3日			0.975	2M					2W	1.000
4日			1.130	3M	1.190	1.220	1.216		3W	1.000
5日				4M			1.300		1M	1.001
6日				5M				3M	0.910	3M	1.004
有担保コール（速報）				6M				6M	0.975	6M	1.053
翌日物			0.930	1Y				1Y	1.170	1Y	1.159

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
2.595	▲ 0.029	69,360.88	▲ 3,005.46	161.79-81	161.62-64

日付	6/19	6/22	6/23	6/24	6/25
日銀当預残	4,387,300	4,430,200	4,427,200	4,398,200	4,403,900
準備預金残	4,071,800	4,106,400	4,105,100	4,097,100	4,099,300
マネタリーベース	5,581,600	5,624,700	5,622,400	5,593,500	5,599,900
無担O/N加重平均	0.977%	0.977%	0.976%	0.977%	0.978%
コール市場残高	113,337	115,682	118,798	116,501	117,118
うち無担	88,171	90,253	92,196	91,803	92,182
うちO/N	32,186	33,568	34,531	33,998	34,237
うち有担	25,166	25,429	26,602	24,698	24,936

●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	1390	－	41,000	2026/6/29	2026/9/28	92,606	31,284.7	99.7700	0.9246%	79.3630%	99.7734	0.9109%	9,715	

●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	2026/6/29				8,622	2,552	0.004		0.006	26.1
国債買入（残存期間5年超10年以下）	2,400	2026/6/29				5,817	2,404	0.002		0.005	60.7
国債買入（残存期間25年超）	750	2026/6/29				2,555	751	0.007		0.015	32.5
国債買入（物価連動債）	400	2026/6/29				1,379	400		▲0.310	▲0.330	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/6/26	2026/6/29		0.750	876	876		0.750	0.750	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/26	2026/6/29		0.750	0	0				

※1. オペの種類が、国債補完供給（国債売現先）、米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）の場合は、上限期間利回り。国債買現先の場合は、下限期間利回り。国債買入の場合は、下限利回較差。国債買入（固定利回り方式）の場合は、固定利回較差。

●2026年6月29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