Central Daily Market Report

2026年6月16日（火）
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16日 需給速報	2026年6月17日 需給予想	2026年6月18日 当社予想
銀行券	200	▲ 700	100
財政	▲ 3,000	13,800	4,500
資金過不足	▲ 2,800	13,100	4,600

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）						▲ 70,188
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 2,500	4,000		2,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,500		15,600		▲ 65,588	

当座預金残高	4,452,100	4,467,700	4,402,112
準備預金残高	4,134,700		
積み終了先	1,940,300	6月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,041,400	積数	987,500
非準備預金先	317,400	1日平均	34,100
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	75.80%	日数 3.33%

●2026年6月16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。

日銀金融政策決定会合では、政策金利を1.0%に引き上げることが決定された。

<レポ市場>
GC T/Nは、0.985～1.01%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>
16日のアウトライト市場は、3M物と1Y物で出合いが見られた。

<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。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

6/16	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	0.700	0.729	0.727	1W	0.993	1.110	1.041	
T/N				2W			1.240	
S/N				3W				
2日				1M	1.065	1.230	1.126	
3日				2M				
4日				3M			1.190	
5日				4M				
6日			1.100	5M				
有担保コール（速報）				6M				
翌日物			0.680	1Y				

T+0	0.735	3M	0.899	3M	0.999			
T+1	0.998							
1W	0.998							
2W	0.998							
3W	0.998							
1M	0.999							
3M	0.999	6M	1.030	6M	1.026			
6M	1.026	1Y	1.145	1Y	1.150			
1Y	1.150							

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	+0.070	69,404.50	+87.00	160.24-25	160.22-24

日付	6/9	6/10	6/11	6/12	6/15
日銀当預残	4,376,200	4,364,900	4,348,800	4,375,000	4,453,600
準備預金残	4,066,100	4,061,200	4,044,700	4,065,600	4,141,500
マネタリーベース	5,569,400	5,558,200	5,542,200	5,568,600	5,647,000
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	115,806	116,171	116,826	116,419	120,998
うち無担	92,046	91,845	92,756	92,409	95,733
うちO/N	33,162	32,291	33,752	33,155	35,969
うち有担	23,760	24,326	24,070	24,010	25,265

金融市場調節方針の変更について
1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した（賛成7反対1）。
無担保コールレート（オーバーナイト物）を、1．0%程度で推移するよう促す。
2. 上記の金融市場調節方針の変更に伴い、以下のとおり、各種制度の適用利率の変更を決定した（賛成7反対1）。
（1）補完当座預金制度の適用利率
補完当座預金制度の適用利率（日本銀行当座預金＜所要準備額相当部分を除く＞への付利金利）については、1．0%とする。
（2）基準貸付利率
補完貸付制度については、その適用金利である基準貸付利率を1．25%とする。
3. 月間の長期国債の買入れ予定額を、2027 年1～3月までは原則として毎四半期2,000 億円程度ずつ減額し、2027 年4月以降は月間2兆円程度の買入れを行う（賛成7反対1）。

●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
米ドル資金供給		2026/6/18	2026/6/25	3.880		1	1				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/6/16	2026/6/17		0.550	2,664	2,664		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/16	2026/6/17		0.550	0	0				

●2026年6月17日の予定

*4月の機械受注統計
*5月の貿易統計
*4月の石油等消費動態統計
*米FOMC(2日目)
*FRB 米経済見通し発表
*5月の米小売売上高
*4月の米企業在庫
*5月のユーロ圏消費者物価指数改定値
*5月の英消費者物価指数

◆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