Central Daily Market Report

2026年6月22日（月）
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22日 需給速報	2026年6月23日 需給予想	2026年6月24日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 500	▲ 500
財政	44,100	▲ 3,400	▲ 28,200
資金過不足	43,800	▲ 3,900	▲ 28,700

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						▲ 8,000
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）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 2,100	1,200		2,100		
＊ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	42,900		▲ 1,900		▲ 36,700	

当座預金残高	4,430,200	4,428,300	4,391,600
準備預金残高	4,106,400		
積み終了先	4,098,800	6月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,098,300	積数	24,300
非準備預金先	323,800	1日平均	1,100
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 99.40%	日数	23.33%

●2026年6月22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、0.977～0.978%程度で推移した。
ターム物では、ショートターム物を中心に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>
22日のアウトライト市場は、1Y物で出合いが見られた。

<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

6/22	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	0.977	1W			T+0	0.997
T/N				2W			T+1	1.000
S/N				3W				
2日			0.970	1M			1W	1.000
3日				2M			2W	1.000
4日				3M	1.195	1.220	3W	1.000
5日				4M			1M	1.000
6日	1.100	1.110	1.101	5M			3M	1.002
有担保コール（速報）				6M			6M	1.041
翌日物			0.930	1Y			1Y	1.154

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
2.670	+0.025	72,353.96	+1,103.90	161.42-43	161.73-74

日付	6/15	6/16	6/17	6/18	6/19
日銀当預残	4,453,600	4,452,100	4,470,200	4,403,200	4,387,300
準備預金残	4,141,500	4,134,700	4,164,700	4,101,700	4,071,800
マネタリーベース	5,647,000	5,645,200	5,663,900	5,597,300	5,581,600
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.978%	0.977%	0.977%
コール市場残高	120,998	115,827	112,844	112,691	113,337
うち無担	95,733	91,330	88,097	87,896	88,171
うちO/N	35,969	33,806	33,252	32,581	32,186
うち有担	25,265	24,497	24,747	24,795	25,166

●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）		2026/6/22	2026/6/23		0.750	2,172	2,172		0.750	0.750	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/6/22	2026/6/23		0.750	162	162		0.750	0.750	

●2026年6月23日の予定

＊4月のサービス産業動態統計速報	＊5年利付国債入札 （25,000億円、6/24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