

Central Daily Market Report

2026年5月1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5月1日 需給速報	2026年5月7日 需給予想	2026年5月8日 当社予想			
銀行券	▲ 500	900	2,500			
財政	▲ 29,300	▲ 94,800	0			
資金過不足	▲ 29,800	▲ 93,900	2,500			
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)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 2,300	1,500		2,300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 30,900	▲ 91,600	2,500			
当座預金残高	4,663,700	4,572,100	4,574,600			
準備預金残高	4,329,800					
積み終了先	4,329,800			5月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,329,700			積数	100	
非準備預金先	333,900			1日平均	0	
積み期間(4/16~5/15日)の所要準備額(積数)			4,050,100			
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	70.00%		

●2026年5月1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、0.727~0.728%程度で推移した。ターム物は、ショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レボ市場>

GC T/Nは、0.755%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>

1日はTDB3M物(第1378回)の入札が実施され、事前予想よりも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。この他、1Y物でも出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の発行が観測された。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

5/1	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値		
O/N	0.700	0.729	0.727	1W		0.732		T+0	0.751	
T/N				2W		0.840		T+1	0.753	
S/N				3W		0.800				
2日				1M		0.805		1W	0.750	
3日				2M	0.900	0.910	0.906	2W	0.750	
4日				3M		1.010		3W	0.750	
5日				4M				1M	0.750	
6日			0.850	5M			3M	0.825	3M	0.844
有担保コール(速報)				6M			6M	0.900	6M	0.938
翌日物			0.680	1Y			1Y	1.070	1Y	1.087

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
2.500	▲ 0.015	59,513.12	+228.20	156.97-99	156.61-63
日付	4/23	4/24	4/27	4/28	4/30
日銀当預残	4,663,200	4,693,100	4,678,100	4,690,600	4,694,600
準備預金残	4,301,300	4,341,400	4,320,400	4,340,900	4,346,000
マネタリーベース	5,871,400	5,903,000	5,889,000	5,903,200	5,909,100
無担O/N加重平均	0.727%	0.728%	0.727%	0.727%	0.727%
コール市場残高	107,822	106,803	103,743	102,494	103,457
うち無担	82,857	81,754	78,934	78,914	80,475
うちO/N	28,694	28,301	25,251	25,781	28,562
うち有担	24,965	25,049	24,809	23,580	22,982

●入札結果

名称	回数	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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1378	-	46,000	2026/5/7	2026/8/3	121,289	35,090.8	99,798.5	0.8374%	81.6546%	99,799.9	0.8316%	10,909	
物価連動10年	31	0.6%	2,500	2026/5/7	2036/3/10	8,486	2,499	100.20	0.5780%	15.0684%				
交付税特会	-	-	11,000	2026/5/15	2026/11/12	52,104	10,999.99		1.100%	22.7199%		1.083%		-

●オペ結果

種別	オフア一額(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(午前オフア一)		2026/5/1	2026/5/7		0.550	2,551	2,551		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア一)		2026/5/1	2026/5/7		0.550	0	0				

●2026年5月4日の予定

*みどりの日

*3月の米製造業新規受注・出荷・在庫

*London祝日(Early May Bank Holiday)

●2026年5月5日の予定

*こどもの日

*3月の米貿易収支

*4月のISM非製造業景況指数

●2026年5月6日の予定

*振替休日

●2026年5月7日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(3月18、19日分)

*4月のマネタリーベース

*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み

*3月の米消費者信用残高

*2・3月の米建設支出

*国庫短期証券(第1379回)入札

(6か月、38,000億円、5/11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預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