

Central Daily Market Report

2026年5月12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5月12日 需給速報	2026年5月13日 需給予想	2026年5月14日 当社予想			
銀行券	2,100	1,300	1,300			
財政	▲ 5,500	▲ 22,100	1,000			
資金過不足	▲ 3,400	▲ 20,800	2,300			
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		8,000	▲ 8,000			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,600					
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	▲ 1,900	3,100	1,900			
米ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	4,400	▲ 18,900	2,300			
当座預金残高	4,540,700	4,521,800	4,524,100			
準備預金残高	4,203,300					
積み終了先	4,203,300			5月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,203,300			積数	0	
非準備預金先	337,400			1日平均	0	
積み期間(4/16~5/15日)の所要準備額(積数)					4,070,400	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	90.00%		

●2026年5月12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、出合いの水準は0.727~0.728%程度で推移した。ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.755%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>

12日のアウトライト市場は、3M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。

●短期金融市場関連指標

5/12 単位：%	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	売買取統計値	平均値		
O/N	0.700	0.775	0.727	1W	0.731	0.783	0.764	T+0	0.749	
T/N				2W			0.900	T+1	0.754	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.750	
3日				2M				2W	0.750	
4日				3M			1.025	3W	0.750	
5日				4M				1M	0.750	
6日			0.850	5M				3M	0.866	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.946	
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.092	

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	
2.540	+0.020	62,742.57	+324.69	157.24-26	157.50-51	
日付		4/30	5/1	5/7	5/8	5/11
日銀当預残	4,694,600	4,663,700	4,585,800	4,543,500	4,536,300	
準備預金残	4,346,000	4,329,800	4,245,100	4,202,300	4,206,500	
マネタリーベース	5,909,100	5,878,600	5,799,700	5,754,000	5,744,800	
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%	0.726%	
コール市場残高	103,457	104,832	114,974	105,463	110,909	
うち無担	80,475	80,939	91,058	80,841	85,484	
うちO/N	28,562	28,710	38,659	27,342	30,675	
うち有担	22,982	23,893	23,916	24,622	25,425	

●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	382	2.4%	26,000	2026/5/13	2036/3/20	76,166	19,510	98.86	2.544%	27.5558%	98.89	2.540%	6,485	2.17
交付税特会	-	-	11,000	2026/5/22	2026/11/18	52,275	11,000		1.099%	26.4680%		1.082%		-

●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		2026/5/14	2026/5/21	3.880		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/5/12	2026/5/13		0.550	2,112	2,112		0.550	0.550	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2026/5/13	2026/5/27	0.750		18,469	8,009				43.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/5/12	2026/5/13		0.550	0	0				

●2026年5月13日の予定

*3月の国際収支	*4月の米生産者物価指数
*4月の景気ウォッチャー調査	*1-3月期のユーロ圏GDP2次速報値

◆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選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