

Central Daily Market Report

2026年5月20日(水)
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20日 需給速報	2026年5月21日 需給予想	2026年5月22日 当社予想			
銀行券	300	0	▲ 1,000			
財政	4,700	▲ 7,500	1,000			
資金過不足	5,000	▲ 7,500	0			
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						
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 1,300	600	1,300			
当預増減	4,300	▲ 6,200	0			
当座預金残高	4,503,200	4,497,000	4,497,000			
準備預金残高	4,196,200					
積み終了先	4,181,900			5月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,174,000			積数	34,600	
非準備預金先	307,000			1日平均	1,300	
積み期間(5/16~6/15日)の所要準備額(積数)				4,197,500		
準備預金進捗率	実績	99.18%	日数	16.13%		

●2026年5月20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、証券業態の調達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>

20日のアウトライト市場は、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態から大型発行が見られた。
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

5/20 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	売買取引統計値	平均値		
O/N	0.700	0.780	0.728	1W	0.733	0.860	0.776	T+0	0.752	
T/N				2W				T+1	0.755	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.750	
3日				2M				2W	0.750	
4日				3M				3W	0.750	
5日				4M				1M	0.772	
6日	0.732	0.740	0.735	5M				3M	0.903	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.956	
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.111	

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	
2.785	▲ 0.015	59,804.41	▲ 746.18	159.04-06	159.06-08	
日付		5/13	5/14	5/15	5/18	5/19
日銀当預残	4,520,600	4,531,500	4,529,900	4,533,300	4,498,900	
準備預金残	4,190,000	4,208,400	4,204,400	4,204,300	4,187,700	
マネタリーベース	5,725,500	5,735,400	5,732,300	5,734,400	5,699,100	
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.727%	0.728%	0.728%	
コール市場残高	112,804	114,117	114,214	113,260	114,825	
うち無担	87,423	88,286	87,871	87,318	89,001	
うちO/N	29,914	31,757	31,392	30,309	32,442	
うち有担	25,381	25,831	26,343	25,942	25,824	

●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非償付競争入札(億円)	非償付入札(億円)
20年利付国債	196	3.4%	7,000	2026/5/21	2046/3/20	21,090	5,258	96.40	3.715%	57.6120%	96.44	3.711%	1,738	

●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)		2026/5/20	2026/5/21		0.550	1,503	1,503		0.550	0.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/5/20	2026/5/21		0.550	0	0				

●2026年5月21日の予定

*小枝日銀審議委員 福岡県金融経済懇談会における挨拶	*4月の米住宅着工件数	*交付税特別会計借入(11,000億円、5/29借入)
*3月の機械受注統計		
*4月の貿易統計		

◆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