

Central Daily Market Report

2026年5月21日(木)
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21日 需給速報	2026年5月22日 需給予想	2026年5月25日 当社予想			
銀行券	0	0	1,100			
財政	▲ 7,200	11,000	▲ 4,000			
資金過不足	▲ 7,200	11,000	▲ 2,900			
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		7,700				
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						
国債補充供給	▲ 1,400	1,300	1,400			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増増減	▲ 7,300	20,100	▲ 2,900			
当座預金残高	4,495,900	4,516,000	4,513,100			
準備預金残高	4,185,100					
積み終了先	4,177,400			5月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,174,600			積数	24,100	
非準備預金先	310,800			1日平均	1,000	
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	99.43%	日数	19.35%		

●2026年5月21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>

21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、五・十日発行にあたり、複数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

5/21 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	売買参考統計値	平均値	T+0	T+1	
O/N	0.700	0.780	0.727	1W	0.733	0.780	0.752		T+0	0.750	
T/N				2W	0.783	0.815	0.791		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	0.787	
6日				5M				3M	0.875	3M	0.909
有担保コール(速報)				6M				6M	0.940	6M	0.960
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.130	1Y	1.113

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	
2.760	▲ 0.025	61,684.14	+1,879.73	158.88-90	159.02-04	
日付		5/14	5/15	5/18	5/19	5/20
日銀当預残	4,531,500	4,529,900	4,533,300	4,498,900	4,503,200	
準備預金残	4,208,400	4,204,400	4,204,300	4,187,700	4,196,200	
マネタリーベース	5,735,400	5,732,300	5,734,400	5,699,100	5,703,100	
無担O/N加重平均	0.727%	0.727%	0.728%	0.728%	0.728%	
コール市場残高	114,117	114,214	113,260	114,825	115,125	
うち無担	88,286	87,871	87,318	89,001	89,326	
うちO/N	31,757	31,392	30,309	32,442	33,227	
うち有担	25,831	26,343	25,942	25,824	25,799	

●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非償付競争入札(億円)	非償付入札(億円)
交付税特会	-	-	11,000	2026/5/29	2026/11/30	47,149	11,000		1.094%	78.8555%		1.088%		-

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,550	2026/5/22				7,938	2,553	▲0.002		0.000	47.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,300	2026/5/22				4,770	2,302	▲0.011		▲0.009	61.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	2,400	2026/5/22				7,988	2,402	▲0.013		▲0.012	45.8
国債買入(残存期間25年超)	750	2026/5/22				1,563	751	▲0.077		▲0.055	40.0
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2026/5/21	2026/5/22		0.550	1,584	1,584		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先・即日(午後オファー分))		2026/5/21	2026/5/22		0.550	0	0				

●2026年5月22日の予定

*4月の全国消費者物価指数	*国庫短期証券(第1383回)入札(3か月、44,000億円、5/25発行)
	*流動性供給入札(6,500億円、5/25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たい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