

Central Daily Market Report

2026年5月22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22日 需給速報	2026年5月25日 需給予想	2026年5月26日 当社予想			
銀行券	0	500	1,000			
財政	11,400	2,400	▲ 2,500			
資金過不足	11,400	2,900	▲ 1,500			
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	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				▲ 400		
気候変動対応オペ						
国債補充供給	▲ 2,200	1,400		2,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当増減	18,300	4,700	▲ 1,500			
当座預金残高	4,514,200	4,518,900	4,517,400			
準備預金残高	4,167,900					
積み終了先	4,165,600		5月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,163,400		積数	10,500		
非準備預金先	346,300		1日平均	500		
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	99.75%	日数	29.03%		

●2026年5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、0.727~0.728%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>

22日はTDB3M物(第1383回)の入札が実施され、事前予想対比で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。その他1Y物でも出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件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

5/22 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		
O/N	0.700	0.729	0.726	1W				T+0	0.751	
T/N				2W				T+1	0.755	
S/N				3W						
2日				1M				1W	0.750	
3日				2M				2W	0.750	
4日			0.850	3M	1.040	1.100	1.062	3W	0.750	
5日				4M				1M	0.797	
6日				5M				3M	0.914	
有担保コール(速報)				6M				6M	0.940	
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.115	

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	0.000	63,339.07	+1,654.93	159.02-04	159.12-13	
日付	5/15	5/18	5/19	5/20	5/21	
日銀当預残	4,529,900	4,533,300	4,498,900	4,503,200	4,495,900	
準備預金残	4,204,400	4,204,300	4,187,700	4,196,200	4,185,100	
マネタリーベース	5,732,300	5,734,400	5,699,100	5,703,100	5,695,800	
無担O/N加重平均	0.727%	0.728%	0.728%	0.728%	0.727%	
コール市場残高	114,214	113,260	114,825	115,125	112,943	
うち無担	87,871	87,318	89,001	89,326	88,671	
うちO/N	31,392	30,309	32,442	33,227	32,882	
うち有担	26,343	25,942	25,824	25,799	24,272	

●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	1383	-	44,000	2026/5/25	2026/8/24	142,623	33,646.8	99.7785	0.8904%	38.9285%	99.7801	0.8839%	10,353	
流動性供給	454	-	6,500	2026/5/25	-	16,289	6,490		0.019%	63.1875%		0.014%		

●オペ結果

種類	オフア額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率(%)	利回り(%)※1	店札総額(億円・百万ドル)	簿札総額(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	平均簿札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2026/5/22	2026/5/25		0.550	2,471	2,471		0.550	0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2026/5/22	2026/5/25		0.550	2	2		0.550	0.550	

●2026年5月25日の予定

*3月のサービス産業動態統計速報

*New York祝日(Memorial Day)

*London祝日(Spring Bank Holiday)

*5年クライマート・トランジション利付国債入札

◆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