Central Daily Market Report

2026年5月28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28日 需給速報	2026年5月29日 需給予想	2026年6月1日 当社予想
銀行券	200	600	500
財政	1,400	200	▲ 40,000
資金過不足	1,600	800	▲ 39,500

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			5,300			
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	▲ 700	100		700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減		1,000		6,800		▲ 39,500

当座預金残高	4,522,700	4,529,500	4,490,000
準備預金残高	4,220,700		
積み終了先	4,219,800	5月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,219,800	積数	6,200
非準備預金先	302,000	1日平均	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	99.85%	日数 41.94%

●2026年5月28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。

<レポ市場>
GC T/Nは、0.745～0.755%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>
28日のアウトライト市場は、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>
CP発行市場は大型発行を含め、複数の業態で発行が観測された。
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

5/28	無担保コール（速報）							短国		東京レポレート	
単位：%	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	0.728	0.727	1W	0.731	0.805	0.768			T+0	0.752
T/N				2W	0.775	0.800	0.784			T+1	0.750
S/N				3W							
2日				1M			0.900			1W	0.750
3日				2M			0.990			2W	0.750
4日				3M			1.080			3W	0.754
5日				4M						1M	0.817
6日			0.850	5M				3M	0.850	3M	0.921
有担保コール（速報）				6M				6M	0.940	6M	0.971
翌日物			0.680	1Y				1Y	1.095	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
2.695	+0.005	64,693.12	▲ 306.29	159.57-58	159.46-48

日付	5/21	5/22	5/25	5/26	5/27
日銀当預残	4,495,900	4,514,200	4,519,100	4,523,800	4,521,700
準備預金残	4,185,100	4,168,400	4,198,000	4,210,400	4,216,900
マネタリーベース	5,695,800	5,714,100	5,718,400	5,722,600	5,720,500
無担O/N加重平均	0.727%	0.726%	0.727%	0.727%	0.727%
コール市場残高	112,943	110,696	112,842	111,355	110,651
うち無担	88,671	86,130	87,248	86,841	87,168
うちO/N	32,882	30,511	31,329	31,502	30,399
うち有担	24,272	24,566	25,594	24,514	23,483

●入札結果

本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。

●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3年超5年以下）	2,300	2026/5/29				2,875	2,301	▲0.040		▲0.024	15.7
国債買入（残存期間5年超10年以下）	2,400	2026/5/29				4,823	2,404	▲0.013		▲0.009	15.1
国債買入（残存期間10年超25年以下）	800	2026/5/29				2,760	801	0.015		0.022	49.6
国債買入（物価連動債）	400	2026/5/29				1,637	401	▲0.550		▲0.769	2.1
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/5/28	2026/5/29		0.550	787	787		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/5/28	2026/5/29		0.550	0	0				

●2026年5月29日の予定

*4月の労働力調査
*5月の都区部消費者物価指数
*4月の一般職業紹介状況(有効求人倍率 厚生労働省
*4月の商業動態統計速報
*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
*5月の消費動向調査
*5月のシカゴPM景況感指数
*国庫短期証券(第1384回)入札
（3か月、44,000億円、6/1発行）
*2年利付国債入札
（28,000億円、6/1発行）

◆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