Central Daily Market Report

2026年5月29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29日 需給速報	2026年6月1日 需給予想	2026年6月2日 当社予想
銀行券	700	500	300
財政	▲ 8,100	▲ 46,800	▲ 40,000
資金過不足	▲ 7,400	▲ 46,300	▲ 39,700

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				▲ 100		
気候変動対応オペ						
国債補完供給		700				
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,400		▲ 46,400		▲ 39,700	

当座預金残高	4,521,300	4,474,900	4,435,200
準備預金残高	4,216,400		
積み終了先	4,215,400	6月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,215,300	積数	3,000
非準備預金先	304,900	1日平均	200

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	99.93%	日数 51.61%

●2026年5月29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、0.75～0.755%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>
29日はTDB3M物（第1384回）の入札が実施され、無難な結果となった。セカンダリーでは、軟調に推移した。

<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

5/29	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		売買参考統計値		平均値	
O/N	0.700	0.729	0.727	1W	0.733	0.780	0.772	T+0 0.752
T/N				2W				T+1 0.755
S/N				3W			0.920	
2日				1M			0.990	1W 0.750
3日			0.725	2M				2W 0.750
4日				3M			1.090	3W 0.764
5日				4M				1M 0.824
6日				5M				3M 0.895 3M 0.922
有担保コール（速報）				6M				6M 0.954 6M 0.973
翌日物			0.680	1Y				1Y 1.105 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
2.655	▲ 0.040	66,329.50	+1,636.38	159.26-28	159.26-28

日付	5/22	5/25	5/26	5/27	5/28
日銀当預残	4,514,200	4,519,100	4,523,800	4,521,700	4,522,700
準備預金残	4,168,400	4,198,000	4,210,400	4,216,900	4,220,700
マネタリーベース	5,714,100	5,718,400	5,722,600	5,720,500	5,721,100
無担O/N加重平均	0.726%	0.727%	0.727%	0.727%	0.727%
コール市場残高	110,696	112,842	111,355	110,651	116,746
うち無担	86,130	87,248	86,841	87,168	92,465
うちO/N	30,511	31,329	31,502	30,399	35,216
うち有担	24,566	25,594	24,514	23,483	24,281

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1384	－	44,000	2026/6/1	2026/8/31	103,288	33,557.8	99.7770	0.8964%	83.4653%	99.7802	0.8835%	10,442	
2年利付国債	485	1.4%	28,000	2026/6/1	2028/6/1	78,905	21,347	100.040	1.379%	27.0498%	100.060	1.369%	6,648	1.5

●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）		2026/5/29	2026/6/1		0.550	24	24		0.550	0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/5/29	2026/6/1		0.550	0	0				

●2026年6月1日の予定

*5月のISM製造業景況指数
*4月の米建設支出

◆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