Central Daily Market Report

2026年5月26日（火）
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26日 需給速報	2026年5月27日 需給予想	2026年5月28日 当社予想
銀行券	500	100	500
財政	4,100	▲ 2,200	▲ 8,000
資金過不足	4,600	▲ 2,100	▲ 7,500

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			8,000	▲ 8,000		
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		▲ 200				
気候変動対応オペ						
国債補完供給	▲ 200	500		200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減		4,700		▲ 1,900		▲ 7,500

当座預金残高	4,523,800	4,521,900	4,514,400
準備預金残高	4,210,400		
積み終了先	4,209,800	5月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,209,800	積数	8,100
非準備預金先	313,400	1日平均	400
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 99.81%	日数	35.48%

●2026年5月26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、0.755%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>
26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

5/26	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	0.780	0.727	1W	0.733	0.850	0.786		T+0	0.752
T/N				2W	0.800	0.900	0.867		T+1	0.754
S/N				3W						
2日				1M					1W	0.750
3日				2M					2W	0.750
4日				3M			1.080		3W	0.750
5日				4M					1M	0.810
6日				5M				3M 0.850	3M	0.920
有担保コール（速報）				6M				6M 0.940	6M	0.970
翌日物			0.680	1Y				1Y 1.110	1Y	1.116

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
2.720	+0.030	64,996.09	▲ 162.10	158.96-97	159.19-21

日付	5/19	5/20	5/21	5/22	5/25
日銀当預残	4,498,900	4,503,200	4,495,900	4,514,200	4,519,100
準備預金残	4,187,700	4,196,200	4,185,100	4,168,400	4,198,000
マネタリーベース	5,699,100	5,703,100	5,695,800	5,714,100	5,718,400
無担O/N加重平均	0.728%	0.728%	0.727%	0.726%	0.727%
コール市場残高	114,825	115,125	112,943	110,696	112,842
うち無担	89,001	89,326	88,671	86,130	87,248
うちO/N	32,442	33,227	32,882	30,511	31,329
うち有担	25,824	25,799	24,272	24,566	25,594

●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)
交付税特会	－	－	11,000	2026/6/3	2026/12/3	49,031	10,999.99		1.090%	80.6666%		1.084%		―

●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
米ドル資金供給		2026/5/28	2026/6/4	3.870		0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2026/5/26	2026/5/27		0.550	239	239		0.550	0.542	
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2026/5/27	2026/6/10	0.750		17,691	8,008				45.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2026/5/26	2026/5/27		0.550	0	0				

●2026年5月27日の予定

*4月の企業向けサービス価格指数
*40年利付国債入札（3,000億円、5/28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