



デイリーシグナル

2021年5月12日(水)

短期市場の推移

	5月6日	5月7日	5月10日	5月11日
加重平均金利	▲0.016	▲0.016	▲0.016	▲0.015
東京レボレート(TN)	▲0.089	▲0.083	▲0.085	▲0.091
無コール残	131,989	134,331	141,165	131,217
ON	80,126	82,333	90,932	78,034
その他	51,863	51,998	50,233	53,183
有コール残	19,224	19,498	19,469	19,522

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表
 ※加重平均金利は無担保コールONのもの、無有コール残は無担保・有担保コール残高の意。
 本日の短期市場金利 [%]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.016	▲0.082
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.087
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	-	-	▲0.006	▲0.090
2W	-	-	▲0.002	▲0.091
3W	-	-	0.001	▲0.096
1M	▲0.040	0.050	0.011	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.136

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

5月13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		(米) 4月の生産者物価	
-		(米) 週間新規失業保険申請件数	
-		-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.012%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.005%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.018 ~ ▲0.018	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調整ニーズに変化はなく、出合水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月12日	5月13日	5月12日	5月13日	5月14日	5月15日
券	+1,000	+600			+0	
財政	▲32,600	+3,900			▲4,000	
過不足	▲31,600	+4,500			▲4,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入		+10,000				
共通担保(全店)	▲3,400	+2,900				
CP等買入	▲100		▲100			+1,300
社債等買入						
被災地金融機関支援					▲400	
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	▲22,100	+4,500			▲3,100	
当座預金残高	5,260,300	5,264,800			5,261,700	
準備預金残高	4,625,800					
積み終了先	4,625,800					
超過準備	4,625,800					
非準備先残高	634,500					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.0%					
乖離率	10.0%					

5月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(5/12~5/13)	120	120	▲0.350	▲0.350		
	7	7	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
5月11日時点 6,496,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,597,100
5月13日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

5月14日	3ヶ月 第993回
5月19日	1年 第994回
5月21日	3ヶ月
5月24日	6ヶ月
5月13日	30年
5月17日	物価連動
5月19日	5年
5月21日	20年

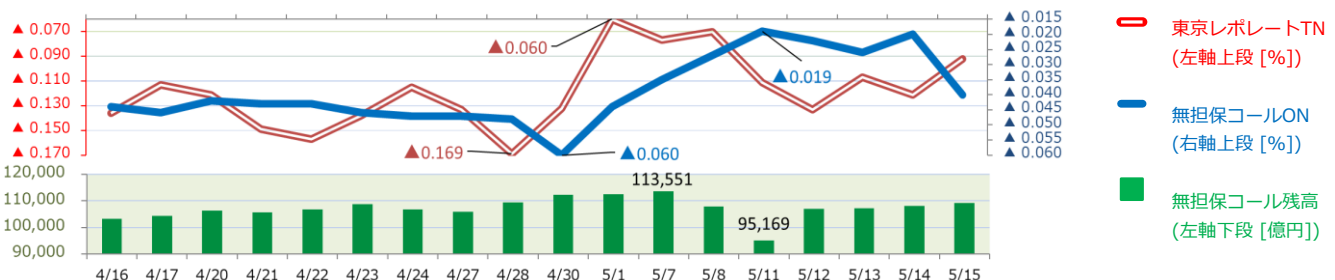
今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	月1回程度	4月5日	1
1年超3年以下	4750	4,750	10 14 20 24	5月10日	3
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	5月10日	3
5年超10年以下	4500	4,500	6 14 20 28	5月6日	3
10年超25年以下	2000	2,000	6	5月6日	0
25年超	500	500	20	4月19日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	4月7日	1
変動利付債<四半期>	300	300	-	4月21日	-

1年前の市場推移

○2020年4月積み期 [4月16日~5月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会