



デイリーシグナル

2021年5月20日(木)

短期市場の推移

	5月14日	5月17日	5月18日	5月19日
加重平均金利	▲0.011	▲0.015	▲0.016	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.090	▲0.092	▲0.091
無コール残	111,643	132,549	140,947	143,637
ON	64,290	81,761	84,739	84,879
その他	47,353	50,788	56,208	58,758
有コール残	19,732	20,706	20,597	18,742

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.015	▲0.088
T/N	▲0.009	▲0.001	▲0.005	▲0.091
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	▲0.012	▲0.008	▲0.010	▲0.093
2W	▲0.015	▲0.005	▲0.010	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.096
1M	▲0.007	▲0.003	▲0.006	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.136

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

5月21日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	消費者物価コア指数		22:45	製造業購買部担当者指数 (PMI)
	-		22:45	サービス業購買部担当者指数 (PMI)
	-		-	-

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲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▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積みであるため地銀業態を中心に調達を積極的に行うため出合の水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月20日		5月21日		5月24日	
債券	+0		+0		+0	
財政	▲32,500		+1,100		▲8,000	
過不足	▲32,500		+1,100		▲8,000	
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
国債買入				+9,900		
CP等買入	▲700		▲400			
国債補完供給	+500					
当座預金増減	▲32,700		+10,600		▲8,000	
当座預金残高	5,256,200		5,266,800		5,258,800	
準備預金残高	4,606,400		主な需給要因			
積み終了先	4,605,300		国庫短期証券			
超過準備	4,604,700		発行・償還(3M)			
非準備先残高	649,800		国債発行(20年)			
準備預金進捗率	99.8%					
平均	16.1%					
乖離率	83.7%					

5月20日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(5/21~)						
1~3年	4,750	12,598	4,760	0.000	0.002	19.8
5~10年	4,500	13,816	4,507	0.003	0.004	82.3
25年~	500	2,275	503	0.006	0.007	76.8
社債等買入(5/25~)						
750	2,756	752	0.063	0.068	64.4	
国債補完供給(5/20~5/21)						
1	1	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マナリーベース	所要
5月19日時点	6,497,500
今積期の所要準備額	3,743,300
5月21日以降の残り所要	
積数	5,800
平均	200

国庫短期証券入札予定

5月21日	3ヶ月	第995回
5月24日	6ヶ月	第996回
5月28日	3ヶ月	
6月4日	3ヶ月	

国債入札予定

5月21日	20年
5月27日	40年
5月31日	2年
6月3日	10年

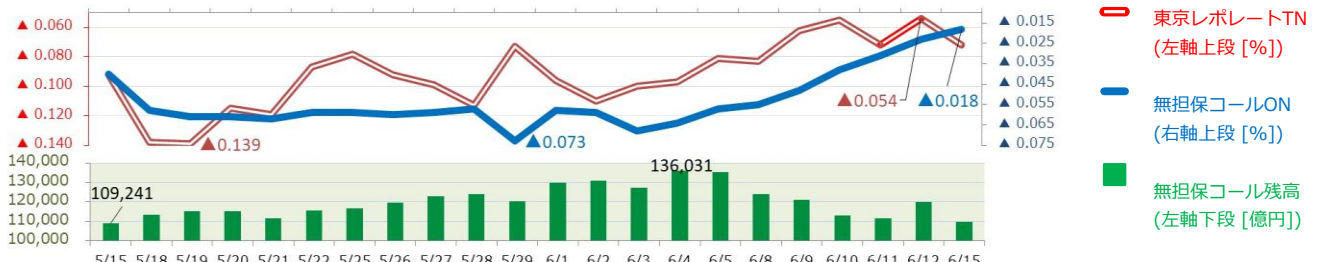
今月の国債買入オペ予定

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20日	1
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	5月14日	2
5年超10年以下	4500	4,500	6 14 20 28	5月20日	1
10年超25年以下	2000	2,000	6	5月6日	0
25年超	500	500	20	5月20日	0
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5月積み期 [5月15日~6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