



デイリーシグナル

2021年5月21日(金)

短期市場の推移

	5月17日	5月18日	5月19日	5月20日
加重平均金利	▲0.015	▲0.016	▲0.016	▲0.015
東京レポレート(TN)	▲0.090	▲0.092	▲0.091	▲0.091
無コール残	132,549	140,947	143,637	144,552
ON	81,761	84,739	84,879	83,264
その他	50,788	56,208	58,758	61,288
有コール残	20,706	20,597	18,742	19,871

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	▲0.075	0.001	▲0.014	▲0.085
T/N	▲0.009	▲0.001	▲0.004	▲0.087
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	▲0.009	▲0.006	▲0.008	▲0.091
2W	▲0.010	0.095	0.016	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.114
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24日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	20:05	【開会挨拶】黒田総裁 (日本銀行金融研究所主催 2021年国際コンファランス)	-	-

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

週末3日積みとなる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▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.060 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末もビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月21日	5月24日	5月24日	5月25日	5月25日	5月25日
券		+0		+200		+0
財政		+1,400		+3,900		▲3,000
過不足		+1,400		+4,100		▲3,000
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	▲400		▲300			
社債等買入						+800
国債補完供給		▲100	+100			
新型コロナ対応金融支援特別						▲37,400
当座預金増減		+10,800		+3,900		▲39,600
当座預金残高		5,267,000		5,270,900		5,231,300
準備預金残高		4,618,000				
積み終了先		4,617,700				
超過準備		4,617,400				
非準備先残高		649,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		25.8%				
乖離率		74.1%				

5月21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(5/21~5/24)	127	127	▲0.350	▲0.350
	0	0		

マネタリーベース (億円)
5月20日時点 6,464,800

所要	今積期の所要準備額	3,743,300
5月24日以降の残り所要	積数	3,800
	平均	200

国庫短期証券入札予定

5月24日	6ヶ月 第996回
5月28日	3ヶ月 第997回
6月4日	3ヶ月
6月9日	6ヶ月

国債入札予定

5月27日	40年
5月31日	2年
6月3日	10年
6月8日	30年

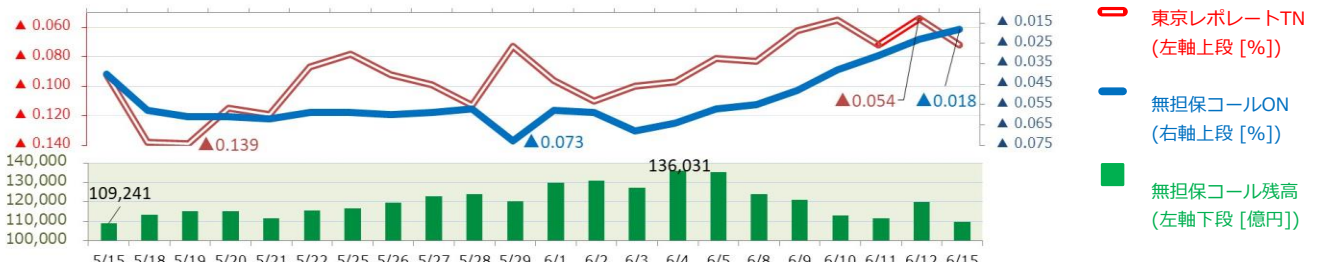
今月の国債買入オペ予定

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
物価運動債	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