



デイリーシグナル

2021年5月24日(月)

短期市場の推移

	5月18日	5月19日	5月20日	5月21日
加重平均金利	▲0.016	▲0.016	▲0.015	▲0.014
東京レボレート(TN)	▲0.092	▲0.091	▲0.091	▲0.087
無コール残	140,947	143,637	144,552	147,972
ON	84,739	84,879	83,264	85,944
その他	56,208	58,758	61,288	62,028
有コール残	20,597	18,742	19,871	21,420

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	▲0.015	▲0.092
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.005	▲0.100
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	▲0.008	▲0.003	▲0.006	▲0.098
2W	▲0.005	0.000	▲0.003	▲0.098
3W	-	-	0.140	▲0.099
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.060	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.114
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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米) 新築住宅販売件数(4月)	95.0万戸
-	-	23:00 (米) 消費者信頼感指数(5月)	120.0
-	-	(米) リフトド* 連銀製造業指数(5月)	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.005%の水準で合出が見られた。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
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

オファーサイド・ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、合出水準は本日対比で横ばいと予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月24日	5月25日	5月24日	5月25日	5月24日	5月25日
券	▲100			+200		+0
財政	+1,100			▲2,800		+4,000
過不足	+1,000			▲2,600		+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
国債買入				+9,300		
共通担保(全店)						▲2,900
CP等買入	▲300		▲400			
社債等買入			▲100		+800	
国債補充供給	+100	▲300	+300			
新型コロナ対応金融支援特別			▲37,400	+55,500		
当座預金増減	+500		+25,400		+1,100	
当座預金残高	5,267,500		5,292,900		5,294,000	
準備預金残高	4,601,500		4,601,200		4,601,200	
積み終了先						
超過準備	4,601,200					
非準備先残高	666,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	29.0%					
乖離率	70.9%					

5月24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(5/25~)						
1~3年	4,750	12,199	4,753	▲0.003	▲0.001	74.7
3~5年	4,500	13,931	4,510	▲0.003	▲0.002	77.0
国債補充供給(5/24~5/25)						
262	262	▲0.350	▲0.350			
0	0					
新型コロナ対応金融支援特別(5/25~11/26)						
55,483	55,483					

マネタリーベース (億円)
5月21日時点 6,475,600

所要	今積期の所要準備額	3,743,300
5月25日以降の残り所要		
積数	3,400	
平均	200	

国庫短期証券入札予定

5月28日	3ヶ月	第997回
6月4日	3ヶ月	
6月9日	6ヶ月	
6月11日	3ヶ月	

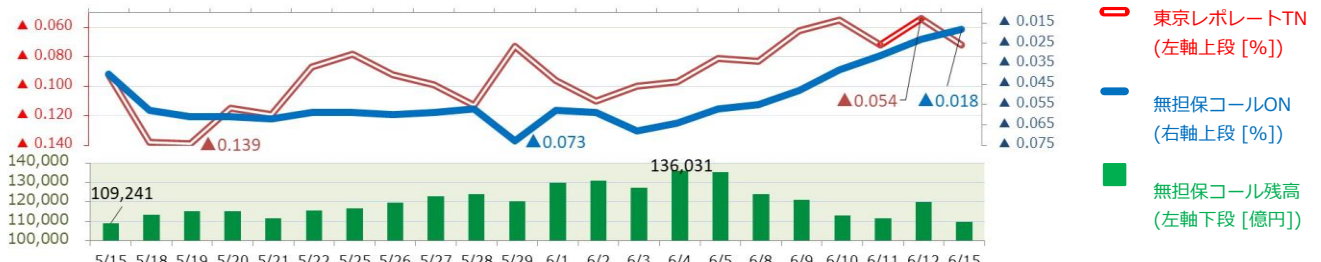
今月の国債買入オペ予定

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24日	0
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	5月24日	1
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