



## デイリーシグナル

2021年5月25日(火)

### 短期市場の推移

	5月19日	5月20日	5月21日	5月24日
加重平均金利	▲0.016	▲0.015	▲0.014	▲0.015
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.091	▲0.087	▲0.100
無コール残	143,637	144,552	147,972	144,010
ON	84,879	83,264	85,944	82,242
その他	58,758	61,288	62,028	61,768
有コール残	18,742	19,871	21,420	21,744

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	▲0.092
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.100
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	-	-	-	▲0.099
2W	▲0.010	▲0.006	▲0.009	▲0.099
3W	-	-	▲0.010	▲0.100
1M	-	-	-	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	0.030	0.100	0.083	▲0.107
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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:30	【挨拶】 鈴木審議委員 (山口)	-	特になし		
	-		-		
	-		-		

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.008%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	▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.008

### 翌営業日のマーケット

調達ニーズに大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばいと予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月25日	5月26日	5月26日	5月27日	5月27日
券	+100	▲700	▲700	▲1,000	▲1,000
財政	▲2,900	+3,300	+3,300	▲13,000	▲13,000
過不足	▲2,800	+2,600	+2,600	▲14,000	▲14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+9,300			
共通担保(全店)		▲2,900	+3,400		
CP等買入	▲400	▲100	▲100		
社債等買入	▲100	+800			
国債補充供給	+300	▲400	+400		
新型コロナ対応金融支援特別	▲37,400	+55,500			
当座預金増減	+24,800	+3,400	+3,400	▲14,000	▲14,000
当座預金残高	5,292,300	5,295,700	5,295,700	5,281,700	5,281,700
準備預金残高	4,617,500				
積み終了先	4,617,100				
超過準備	4,617,100				
非準備預金残高	674,800				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	32.3%				
乖離率	67.6%				

### 5月25日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(5/27~6/4)		0	0	0.310	0.310	
米ドル資金供給(5/27~8/19)		0	0	0.330	0.330	
国債補充供給(5/25~5/26)	314	314	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(5/26~6/9)	20,000	3,351	3,351			

マナタリーベース (億円)  
 5月24日時点 6,476,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,743,300
5月26日以降の残り所要	
積数	3,000
平均	100

### 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	
5月27日	40年	
5月31日	2年	
6月3日	10年	
6月8日	30年	

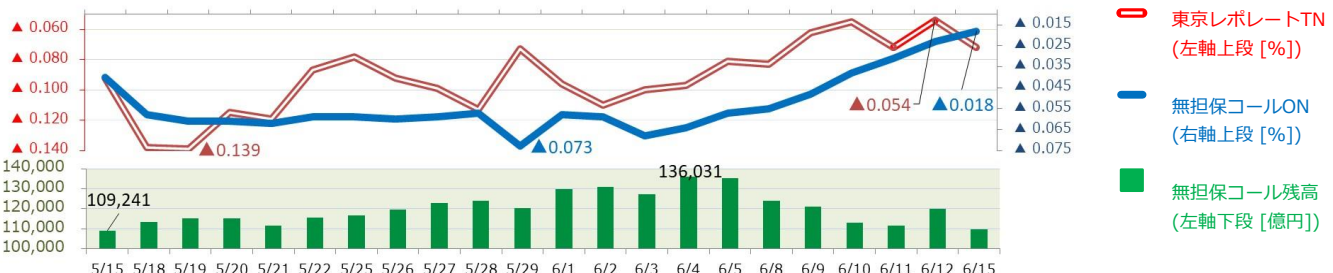
### 今月の国債買入オペ予定

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。投資については最終決定は、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