



デイリーシグナル

2021年5月26日(水)

短期市場の推移

	5月20日	5月21日	5月24日	5月25日
加重平均金利	▲0.015	▲0.014	▲0.015	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.087	▲0.100	▲0.100
無コール残	144,552	147,972	144,010	144,610
ON	83,264	85,944	82,242	81,232
その他	61,288	62,028	61,768	63,378
有コール残	19,871	21,420	21,744	20,120

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	▲0.080	0.001	▲0.018	▲0.101
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.005	▲0.117
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	▲0.015	▲0.006	▲0.010	▲0.106
2W	▲0.010	0.030	▲0.002	▲0.105
3W	▲0.008	0.150	0.017	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.110
6M	-	-	-	▲0.117
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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見要旨】鈴木審議委員 (5月26日分)	-	21:30 (米)国内総生産(GDP)改定値	6.4
-	-	-	-
-	-	-	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.008%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▲0.002%の▲0.018%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.008

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26日	5月27日	5月27日	5月28日	5月28日	5月29日
券	▲800	▲1,100	▲1,100	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+3,700	▲10,800	▲10,800	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	+2,900	▲11,900	▲11,900	▲2,000	▲2,000	▲2,000
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				+5,000		
共通担保(全店)	▲2,900	+3,400				
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+400	▲100	+100			
当座預金増減	+3,600	▲6,900	▲6,900	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	5,295,900	5,289,000	5,289,000	5,287,000	5,287,000	5,287,000
準備預金残高	4,624,600	主な需給要因				
積み終了先	4,624,300	国債発行(40年)				
超過準備	4,624,300					
非準備先残高	671,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	35.5%					
乖離率	64.4%					

5月26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
国庫短期証券買入(5/27~)	5,000	15,338	5,004	▲0.003	▲0.001	9.4
CP等買入(5/31~)	4,000	9,656	3,975	▲0.010	▲0.006	24.7
国債補完供給(5/26~5/27)	139	139	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
5月25日時点 6,500,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,743,300
5月27日以降の残り所要	
積数	2,700
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

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

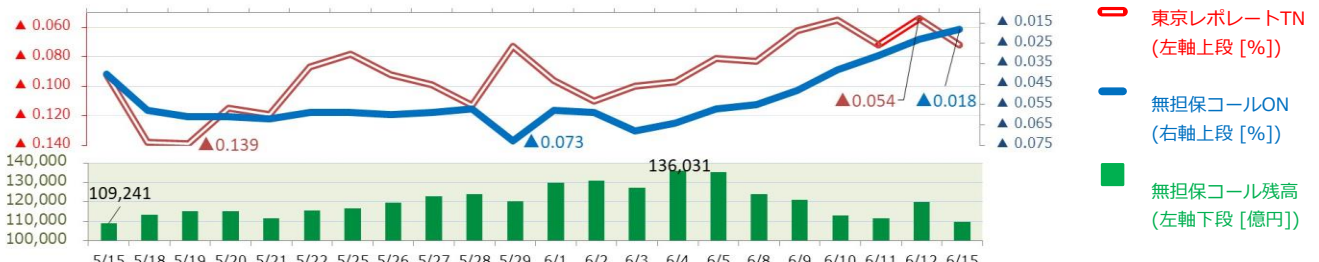
今月の国債買入オペ予定

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