

短期市場の推移

[億円] [%]

	4月16日	4月17日	4月20日	4月21日
加重平均金利	▲0.044	▲0.046	▲0.042	▲0.043
東京レポレート(ON)	▲0.124	▲0.109	▲0.101	▲0.116
無コール残	103,332	104,283	106,277	105,605
ON	67,539	68,540	70,959	71,137
その他	35,793	35,743	35,318	34,468
有コール残	15,014	13,851	16,756	14,434

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	▲0.087	0.001	▲0.043	▲0.113
T/N	-	-	-	▲0.157
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.020	▲0.030	▲0.148
2W	▲0.005	0.015	0.002	▲0.149
3W	-	-	-	▲0.145
1M	-	-	▲0.030	▲0.150
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.184
1Y	-	-	-	▲0.197

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

4月23日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00頃	実質輸出入の動向(詳細)	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
	-	-	22:45	(米)4月製造業購買部担当者指数(PMI)
	-	-	22:45	(米)4月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▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.020%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.055 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に変化はなく、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月22日	4月23日	4月24日
券	▲1,600	▲2,200	▲3,000
財政	▲7,600	+500	+6,000
過不足	▲9,200	▲1,700	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲5,000	▲7,400	▲1,500
国債買入	▲100	▲400	
CP等買入			
社債等買入			
ETF買入	+900	+1,200	
国債補完供給	+300	+100	
米ドル資金供給用担保国債供給	▲21,600		
当座預金増減	▲24,800	+6,600	+4,500
当座預金残高	4,089,300	4,095,900	4,100,400
準備預金残高	3,530,400	主な需給要因	
積み終了先	3,528,500		
超過準備	3,528,500		
非準備先残高	558,900		
準備預金進捗率	99.5%		
平均	23.3%		
乖離率	76.2%		

4月22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(4/23~)						
~1年	800	2,305	802	▲0.002	0.002	90.3
3~5年	2,800	8,308	2,807	▲0.019	▲0.018	83.4
5~10年	3,500	8,657	3,505	▲0.025	▲0.022	56.3

米ドル資金供給(4/24~5/7)

971	971	0.310	0.310
国債補完供給(4/22~4/23)			
113	113	▲0.350	▲0.350
8	8	▲0.350	▲0.350

マネタリーベース [億円]
4月21日時点 5,269,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,209,400
4月23日以降の残り所要
積数 16,500
平均 700

国庫短期証券入札予定

4月24日	3ヶ月	第903回
5月1日	3ヶ月	
5月7日	6ヶ月	
5月8日	3ヶ月	

国債入札予定

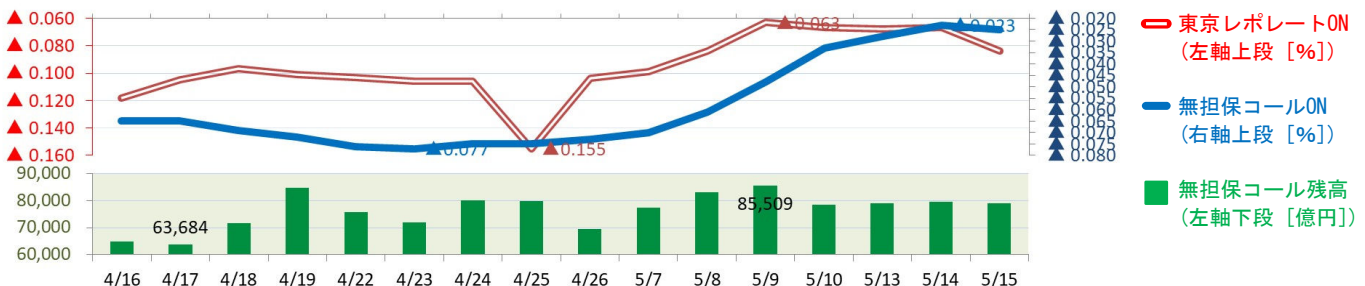
4月23日	2年
5月8日	物価連動
5月12日	10年
5月14日	30年

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	500~1,000 程度	800	月3回程度	4月22日	1
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	3,200	3 8 13 15 17 27	4月17日	1
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	1 3 13 17 22 27	4月22日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 27	4月22日	1
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	3 24	4月3日	1
25年超	0~500 程度	300	3 24	4月3日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	4月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月6日	0

1年前の市場推移 ○2019年4月積み期 [4月16日~5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。