

短期市場の推移

[億円] [%]

	4月21日	4月22日	4月23日	4月24日
加重平均金利	▲0.043	▲0.043	▲0.046	▲0.047
東京レポレート(ON)	▲0.116	▲0.113	▲0.105	▲0.111
無コール残	105,605	106,852	108,683	106,740
ON	71,137	70,554	70,695	68,812
その他	34,468	36,298	37,988	37,928
有コール残	14,434	15,742	16,017	15,114

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。

4月28日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	3月有効求人倍率	1.4倍	23:00	(米)4月消費者信頼感指数
8:30	3月失業率	+2.5%	-	90
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場 東京レポ レート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.087	0.001	▲0.047	▲0.103
T/N	-	-	-	▲0.133
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.050	0.005	▲0.139
2W	▲0.020	0.001	▲0.013	▲0.137
3W	-	-	-	▲0.140
1M	-	-	-	▲0.145
2M	-	-	0.070	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.178
1Y	-	-	-	▲0.192

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.050%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▲0.047%となった。

本日開催された金融政策決定会合ではCP・社債買入れの増額、新型コロナ対応金融支援特別オペの拡充、国債の積極的な買入れが決定された。

	都銀・信託	証券	地銀
	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、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27日	4月28日	4月30日
券	▲2,000	▲2,700	▲2,500
財政	▲2,300	+8,100	+3,000
過不足	▲4,300	+5,400	+500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲2,000	▲400	▲400
共通担保(全店)	▲14,600	+13,400	+6,000
CP等買入	▲400	▲100	-
社債等買入	-	-	-
ETF買入	+1,100	+500	-
国債補完供給	+500	+1,000	-
新型コロナ企業金融支援特別	+200	-	-
当座預金増減	▲3,100	+6,400	+6,500
当座預金残高	4,107,100	4,113,500	4,120,000
準備預金残高	3,562,300	3,560,600	3,560,600
積み終了先	3,560,600	3,560,600	3,560,600
超過準備	3,560,600	3,560,600	3,560,600
非準備先残高	544,800	544,800	544,800
準備預金進捗率	99.8%	99.8%	99.8%
平均	40.0%	40.0%	40.0%
乖離率	59.8%	59.8%	59.8%

4月27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
米ドル資金供給(4/30~5/7)	541	541	0.320	0.320	-	-
国債補完供給(4/27~4/28)	940	940	▲0.350	▲0.350	-	-
	0	0	-	-	-	-

マネタリーベース [億円]
4月24日時点 5,270,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,209,400
4月28日以降の残り所要
積数 7,500
平均 400

国庫短期証券入札予定

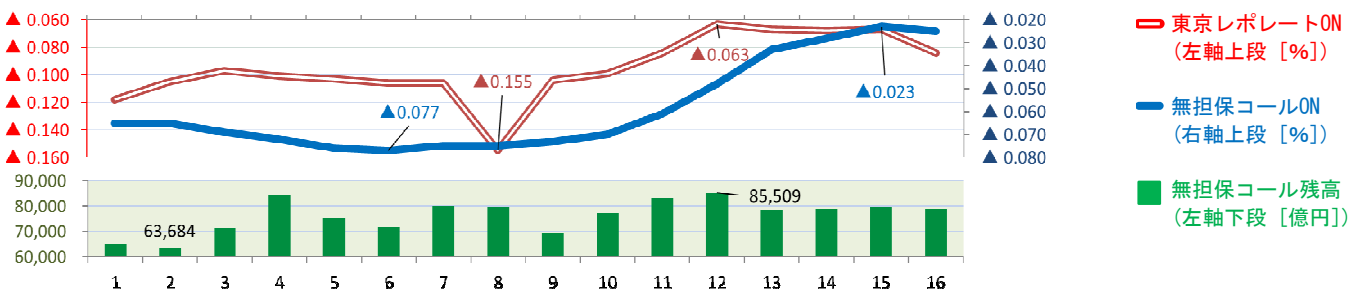
5月1日	3ヶ月	第904回
5月7日	6ヶ月	
5月8日	3ヶ月	
5月15日	3ヶ月	
5月18日	5年	

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 28	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 28	4月22日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 28	4月22日	1
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	3 24	4月24日	0
25年超	0~500 程度	300	3 24	4月24日	0
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	4月24日	0
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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会