



デイリーシグナル

2021年4月20日(火)

短期市場の推移

	4月14日	4月15日	4月16日	4月19日
加重平均金利	▲0.013	▲0.010	▲0.014	▲0.013
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.089	▲0.095	▲0.100
無コール残	121,789	113,386	139,901	140,566
ON	73,996	68,803	89,233	87,428
その他	47,793	44,583	50,668	53,138
有コール残	20,600	20,661	19,355	20,664

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	▲0.013	▲0.092
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.006	▲0.110
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	0.050	0.150	0.086	▲0.106
2W	▲0.008	▲0.006	▲0.007	▲0.109
3W	-	-	▲0.005	▲0.109
1M	-	-	0.050	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.117
1Y	-	-	-	▲0.137

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 週間 MBA住宅ローン申請指数	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.003%の水準で出合が見られた。引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、堅調な地合で推移した。なお同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.018 ~ ▲0.018	▲0.012 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

都銀・地銀を中心とした堅調な地合が続き、出合水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月20日		4月21日		4月22日	
券	▲400		▲1,300		▲2,000	
財政	▲22,100		▲9,400		+2,000	
過不足	▲22,500		▲10,700		+0	
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	+5,000					
共通担保(全店)			▲1,700		+3,400	
CP等買入			▲200			
E T F 買入					+300	
国債補充供給	+1,500	▲100	+100			
当座預金増減	▲16,100		▲8,800		+0	
当座預金残高	5,256,900		5,248,100		5,248,100	
準備預金残高	4,592,500		主な需給要因			
積み終了先	4,591,600		国債発行(20年)			
超過準備	4,591,400					
非準備先残高	664,400					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	16.7%					
乖離率	83.2%					

4月20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(4/22~4/30)	0	0	0.320	0.320		
米ドル資金供給(4/22~7/15)	0	0	0.330	0.330		
国債補充供給(4/20~4/21)	90	90	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(4/21~5/12)	5	5	▲0.350	▲0.350		
	20,000	3,431	3,431			

マネタリーベース (億円)
4月19日時点 6,482,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,599,500
4月21日以降の残り所要	
積数	5,800
平均	200

国庫短期証券入札予定

4月22日	6ヶ月	第989回
4月23日	3ヶ月	第990回
5月6日	6ヶ月	
5月7日	3ヶ月	

国債入札予定

4月28日	2年
5月11日	10年
5月13日	30年
5月17日	物価連動

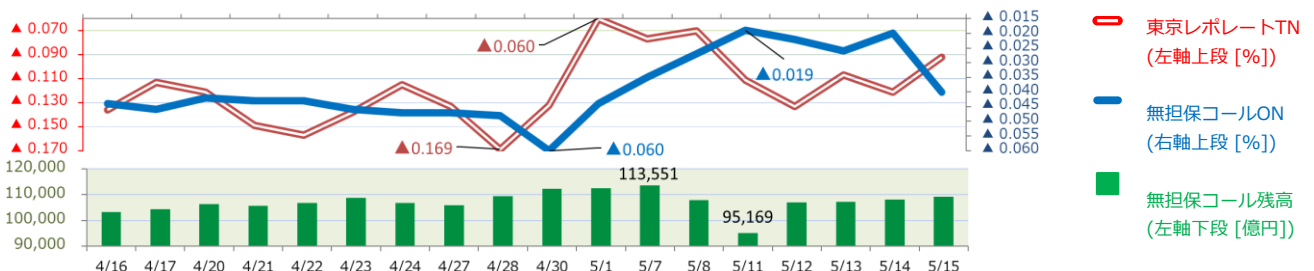
今月の国債買入オペ予定

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	0
1年超3年以下	4750	4,750	5 14 21 26	4月14日	2
3年超5年以下	4500	4,500	5 14 19 26	4月19日	1
5年超10年以下	4500	4,500	7 14 21 26	4月14日	2
10年超25年以下	2000	2,000	7	4月7日	0
25年超	500	500	19	4月19日	0
物価連動債	600	600	月1回程度	4月7日	0
変動利付債<四半期>	300	500	4月21日	2月22日	1

1年前の市場推移

○2020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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会