



短期市場の推移

	4月16日	4月19日	4月20日	4月21日
加重平均金利	▲0.014	▲0.013	▲0.013	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.095	▲0.100	▲0.110	▲0.121
無コール残	139,901	140,566	149,902	151,584
ON	89,233	87,428	95,844	95,811
その他	50,668	53,138	54,058	55,773
有コール残	19,355	20,664	20,085	20,172

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	▲0.080 0.001 ▲0.013	▲0.095
T/N	▲0.010 ▲0.001 ▲0.003	▲0.111
S/N	- - ▲0.009	-
1W	- - ▲0.008	▲0.110
2W	- - ▲0.003	▲0.113
3W	- - -	▲0.112
1M	▲0.008 0.001 ▲0.006	▲0.113
2M	- - -	-
3M	- - -	▲0.112
6M	- - -	▲0.119
1Y	- - -	▲0.138

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

4月23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
3月の消費者物価コア指数	▲0.2%	(米)4月の製造業PMI(速報)	60.0
-	-	(米)4月のサービス業PMI(速報)	61.3
-	-	(米)3月の新築住宅販売件数	86.8万戸

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.003%の水準で合出が見られた。引き続き都銀・地銀を中心に調達意欲は強く、堅調な地合となった。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

3日積みということもあり、出合水準は本日対比やや上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月22日	4月23日	4月26日
券	▲2,100	▲2,000	▲1,000
財政	+6,800	+20,000	▲2,000
過不足	+4,700	+18,000	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+7,500		
国債買入	+9,600		
CP等買入	▲200	▲100	
社債等買入		▲600	
E T F 買入		+200	+800
国債補完供給	+400	+100	
新型コロナ対応金融支援特別		▲27,600	+47,200
当座預金増減	+21,900	+37,200	▲2,200
当座預金残高	5,270,700	5,307,900	5,305,700
準備預金残高	4,610,400	主な需給要因	
積み終了先	4,609,600	国庫短期証券	
超過準備	4,609,400	発行・償還	
非準備先残高	660,300	(3M・6M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	23.3%		
乖離率	76.6%		

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
国債補完供給(4/22~4/23)	124	124	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(4/23~10/28)	0	0				
	47,193	47,193				

マネタリーベース [億円]
4月21日時点 6,459,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,599,500
4月23日以降の残り所要	
積数	3,900
平均	200

国庫短期証券入札予定

4月23日	3ヶ月 第990回
5月6日	6ヶ月
5月7日	3ヶ月
5月14日	3ヶ月

国債入札予定

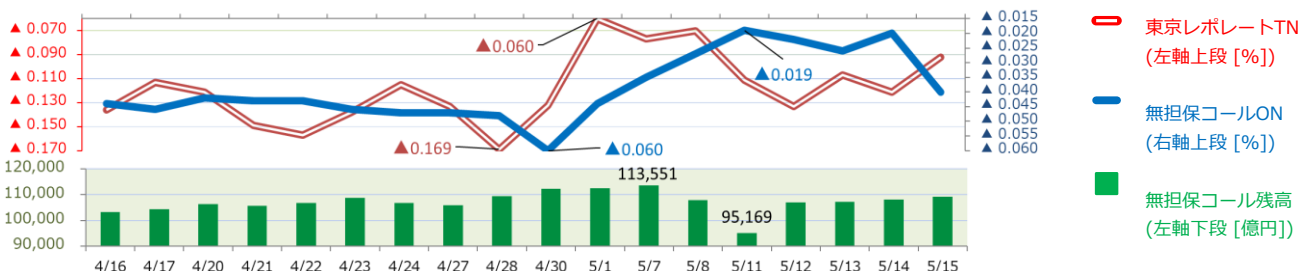
4月28日	2年
5月11日	10年
5月13日	30年
5月17日	物価連動

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		
1年超3年以下	4750	4,750	5/14 21 26	4月5日	0
3年超5年以下	4500	4,500	5/14 19 26	4月21日	1
5年超10年以下	4500	4,500	7/14 21 26	4月21日	1
10年超25年以下	2000	2,000	7/14 21 26	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		
変動利付債<四半期>	300	300	4月21日	4月7日	0
				4月21日	0

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