



デイリーシグナル

2021年4月26日(月)

短期市場の推移

	4月20日	4月21日	4月22日	4月23日
加重平均金利	▲0.013	▲0.013	▲0.013	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.110	▲0.121	▲0.111	▲0.091
無コール残	149,902	151,584	151,263	151,655
ON	95,844	95,811	96,340	92,572
その他	54,058	55,773	54,923	59,083
有コール残	20,085	20,172	19,856	19,560

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	▲0.012	▲0.099
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.100
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.010	▲0.004	▲0.006	▲0.109
2W	▲0.009	▲0.007	▲0.008	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.107
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
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

4月27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
政策委員会・金融政策決定会合の決定内容	-	(米) FOMC (28日まで)	-
経済・物価情勢の展望(4月、基本的見解)	-	(米) 4月 消費者信頼感指数	-
		(米) 4月 リバート連銀製造業指数	-

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▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.002%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▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.012 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

都銀・地銀を中心としたビッドサイドの調達ニーズは底堅く、引き続き堅調な地合になると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月26日		4月27日		4月28日	
券	▲2,100		▲2,700		▲2,000	
財政	▲5,000		+4,900		+5,000	
過不足	▲7,100		+2,200		+3,000	
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
国債買入				+13,900		
CP等買入	▲600		▲200			
社債等買入		+800				
国債補完供給	+400	▲200	+200			
当座預金増減	▲6,700		+16,100		+3,000	
当座預金残高	5,301,800		5,317,900		5,320,900	
準備預金残高	4,637,400		主な需給要因			
積み終了先	4,637,000					
超過準備	4,637,000					
非準備先残高	664,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	36.7%					
乖離率	63.2%					

4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
国債買入(4/27~)						
1~3年	4,750	13,502	4,755	0.001	0.002	29.5
3~5年	4,500	13,546	4,505	0.000	0.001	5.2
5~10年	4,500	14,950	4,508	0.002	0.003	89.2
CP等買入(4/30~)	4,000	9,490	3,985	▲0.024	▲0.017	41.0
国債補完供給(4/26~4/27)						
	177	177	▲0.350	▲0.350		
	2	2	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
4月23日時点 6,523,700

所要	今積期の所要準備額
4月27日以降の残り所要	3,599,500
積数	1,700
平均	100

国庫短期証券入札予定

5月6日	6ヶ月
5月7日	3ヶ月
5月14日	3ヶ月
5月19日	1年
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

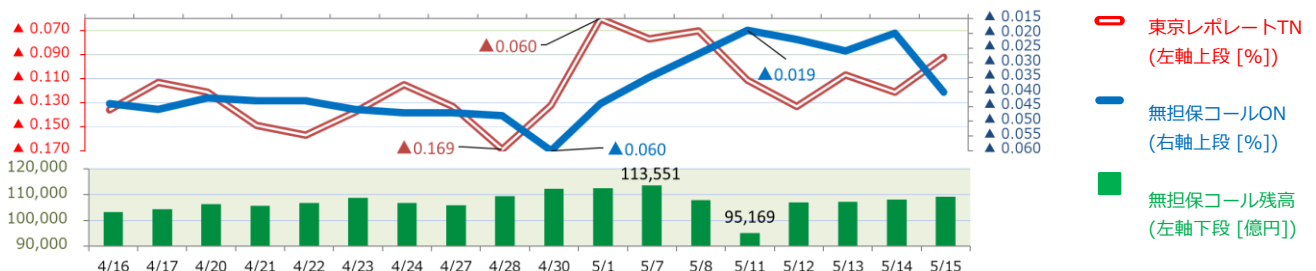
今月の国債買入オペ予定

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26日	0
3年超5年以下	4500	4,500	5 14 19 26	4月26日	0
5年超10年以下	4500	4,500	7 14 21 26	4月26日	0
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	300	4月21日	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