



短期市場の推移

	4月21日	4月22日	4月23日	4月26日
加重平均金利	▲0.013	▲0.013	▲0.012	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.121	▲0.111	▲0.091	▲0.100
無コール残	151,584	151,263	151,655	150,480
ON	95,811	96,340	92,572	93,767
その他	55,773	54,923	59,083	56,713
有コール残	20,172	19,856	19,560	20,729

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	▲0.070	0.001	▲0.013	▲0.092
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.096
S/N	-	-	▲0.008	-
1W	▲0.007	▲0.006	▲0.006	▲0.108
2W	▲0.040	▲0.008	▲0.017	▲0.106
3W	-	-	0.150	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.107
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28日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	【記者会見要旨】黒田総裁 (4月27日分)	-	(米)GDP1次速報値 [1~3月分]	-
14:00	経済・物価情勢の展望 (4月、全文)	-	-	-
	-	-	-	-

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▲0.007%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.003%の水準で合出が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.013%となった。なお、本日公表の日銀金融政策決定会合では、金融緩和策の維持を決定した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

引き続き都銀・地銀を中心としたビッドサイドの調達ニーズは底堅く、出合水準は本日と同程度を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月27日	4月28日	4月28日	4月30日	4月30日	4月30日
券	▲2,900	▲2,800	▲2,900	▲2,900	▲2,900	
財政	+3,800	+7,700	+4,000	+4,000	+4,000	
過不足	+900	+4,900	+1,100	+1,100	+1,100	
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	▲200	▲300	▲4,000			
社債等買入		▲100				
国債補充供給	+200	▲1,700	+1,700			
当座預金増減	+13,100	+6,200	+5,100			
当座預金残高	5,314,900	5,321,100	5,326,200			
準備預金残高	4,647,300	主な需給要因				
積み終了先	4,647,000					
超過準備	4,647,000					
非準備預金先高	667,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	40.0%					
乖離率	59.9%					

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(4/30~5/13)	0	0	0.330	0.330		
米ドル資金供給(4/30~7/15)	0	0	0.330	0.330		
国債補充供給(4/27~4/28)	1,656	1,656	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
4月26日時点 6,519,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,599,500
4月28日以降の残り所要	
積数	1,400
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

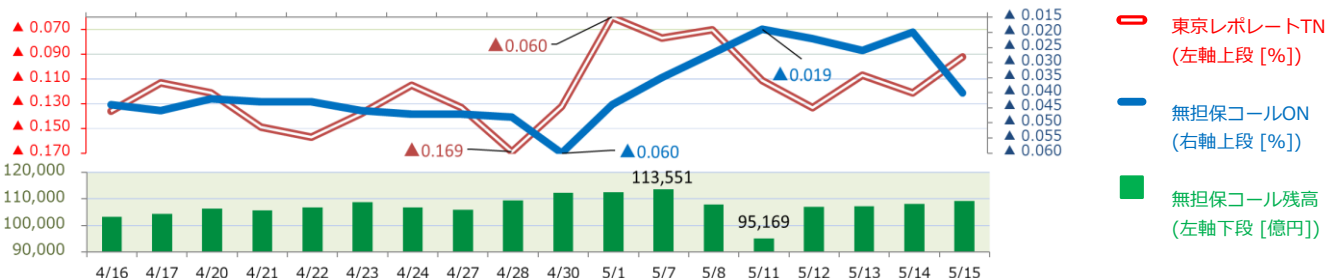
今月の国債買入オペ予定

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