



デイリーシグナル

2021年4月28日(水)

短期市場の推移

	4月22日	4月23日	4月26日	4月27日
加重平均金利	▲0.013	▲0.012	▲0.012	▲0.013
東京レポレート(TN)	▲0.111	▲0.091	▲0.100	▲0.096
無コール残	151,263	151,655	150,480	152,962
ON	96,340	92,572	93,767	96,049
その他	54,923	59,083	56,713	56,913
有コール残	19,856	19,560	20,729	21,905

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	▲0.014	▲0.095
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.103
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.015	0.010	▲0.007	▲0.105
2W	▲0.010	▲0.002	▲0.008	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.105
1M	▲0.010	▲0.008	▲0.009	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.116
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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	失業率	+2.9%	21:30	(米)個人所得	20.0%
	-		21:30	(米)個人消費支出	4.0%
	-			-	

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。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.014%となった。

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

大型連休を跨ぐ取引になることから慎重な調達姿勢となり、合出水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月28日	4月30日	4月30日	5月6日	4月28日	5月6日
券	▲2,800	▲900		+3,000		
財政	+7,900	+3,400		▲25,000		
過不足	+5,100	+2,500		▲22,000		
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
国庫短期証券買入				+7,500		
CP等買入	▲300		▲4,700	+4,000		
社債等買入	▲100		▲200			
国債補完供給	+1,700	▲300	+300			
当座預金増減	+6,100	+9,400		▲22,000		
当座預金残高	5,321,000	5,330,400		5,308,400		
準備預金残高	4,650,900					
積み終了先	4,650,500					
超過準備	4,650,500					
非準備先残高	670,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	46.7%					
乖離率	53.2%					

4月28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
国庫短期証券買入(4/30~)	7,500	30,181	7,505	0.003	0.005	4.4
国債補完供給(4/28~4/30)	301	301	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
4月27日時点 6,535,100

所要	今積期の所要準備額
4月30日以降の残り所要	3,599,500
積数	700
平均	0

国庫短期証券入札予定

5月6日	6ヶ月 第991回
5月7日	3ヶ月
5月14日	3ヶ月
5月19日	1年

国債入札予定

5月11日	10年
5月13日	30年
5月17日	物価連動
5月19日	5年

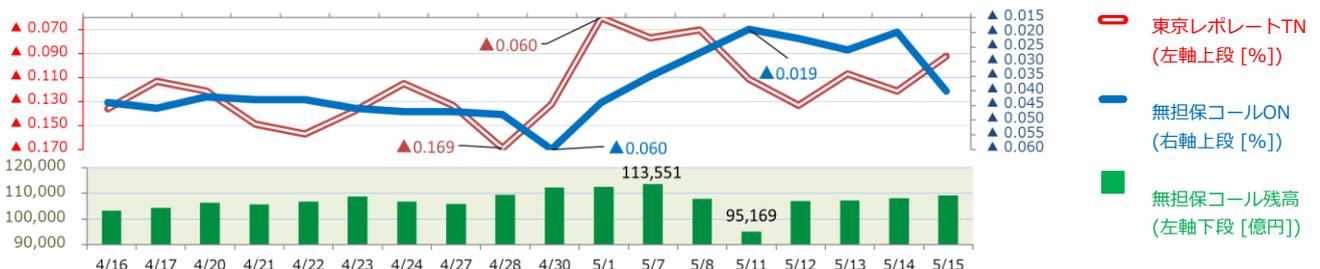
今月の国債買入オペ予定

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	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