



## デイリーシグナル

2021年4月30日(金)

### 短期市場の推移

	4月23日	4月26日	4月27日	4月28日
加重平均金利	▲0.012	▲0.012	▲0.013	▲0.014
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.100	▲0.096	▲0.103
無コール残	151,655	150,480	152,962	153,454
ON	92,572	93,767	96,049	97,081
その他	59,083	56,713	56,913	56,373
有コール残	19,560	20,729	21,905	21,460

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	▲0.075	0.001	▲0.017	▲0.096
T/N	▲0.008	▲0.001	▲0.002	▲0.099
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.010	▲0.005	▲0.008	▲0.101
2W	▲0.015	▲0.003	▲0.007	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.103
1M	▲0.008	0.480	0.028	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
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

### 5月6日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	政策委員会・金融政策 決定会合議事要旨 (3月18・19日分)	-	(米)週間新規失業保険 申請件数	-
13:00	日銀当座預金増減要因と 金融調節 (4月実績)	-	(米)ダラス連銀総裁の講演	-

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。連休6日積みのため調達を控えた先もあり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.017%となった。

[%]		
都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.003

### 翌営業日のマーケット

連休のため本日調達を控えた先が戻り、合出の水準は本日対比上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	4月30日	5月6日	5月6日	5月7日	5月7日
券	▲900	+3,000	+3,000	+3,000	+3,000
財政	+4,100	▲31,600	▲31,600	▲43,000	▲43,000
過不足	+3,200	▲28,600	▲28,600	▲40,000	▲40,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+7,500			
CP等買入	▲4,700	+4,000	▲300		
社債等買入	▲200				
国債補充供給	+300	▲400	+400		
当座預金増減	+9,700	▲28,500	▲28,500	▲40,000	▲40,000
当座預金残高	5,330,700	5,302,200	5,302,200	5,262,200	5,262,200
準備預金残高	4,665,300	主な需給要因			
積み終了先	4,665,300				
超過準備	4,665,200				
非準備先残高	665,400	国債発行・償還			
準備預金進捗率	99.9%	(2年)			
平均	66.7%	税・保険揚げ			
乖離率	33.2%				

### 4月30日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(4/30~5/6)	365	365	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)  
4月28日時点 6,544,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,599,500
5月6日以降の残り所要	
積数	200
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	第992回
5月14日	3ヶ月	
5月19日	1年	
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	

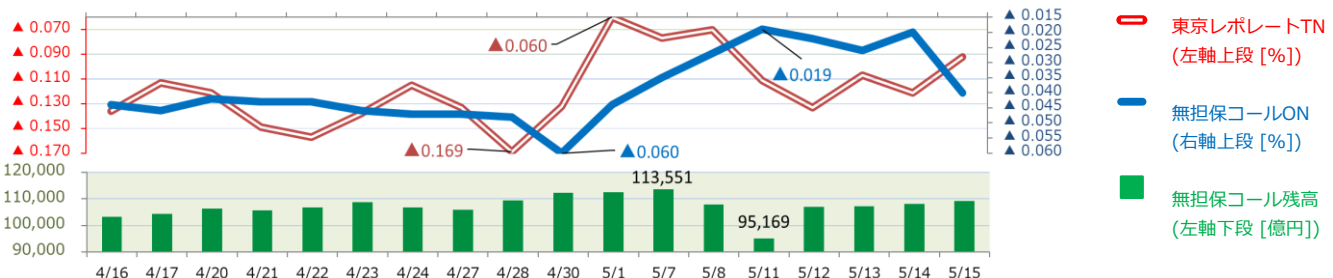
### 来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	4750	4,750	10 14 20 24	4月26日	4
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	4月26日	4
5年超10年以下	4500	4,500	6 14 20 28	4月26日	4
10年超25年以下	2000	2,000	6	4月7日	1
25年超	500	500	20	4月19日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	4月7日	1
変動利付債<四半期>	300	300	-	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