



短期市場の推移

	4月20日	4月21日	4月22日	4月25日
加重平均金利	▲0.016	▲0.016	▲0.015	▲0.016
東京レボレート(TN)	▲0.096	▲0.095	▲0.094	▲0.131
無コール残	159,689	172,446	169,210	167,922
ON	80,156	91,053	95,062	83,834
その他	79,533	81,393	74,148	84,088
有コール残	30,762	30,506	31,527	31,732

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	▲0.055	0.001	▲0.017	▲0.111
T/N	-	-	-	▲0.159
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.005	▲0.150
2W	▲0.020	0.005	▲0.013	▲0.149
3W	-	-	▲0.008	▲0.144
1M	▲0.040	0.150	▲0.007	▲0.135
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.112

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (28日まで)		(米) 貿易収支 (3月)	
-		-	
-		-	

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.010%の水準で取引された。一部の先について調達意欲の減退がみられ同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.028 ~ ▲0.028	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

オファーサイド・ビッドサイドともに動向に大きな変化はなく、本日と横ばい圏での取引を予想。

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27日	4月28日	4月28日
券	▲2,900	▲3,000	▲3,000	▲3,200	▲3,200
財政	+3,600	+3,700	+3,700	+4,400	+4,400
過不足	+700	+700	+700	+1,200	+1,200
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			+5,000		
国債買入		+7,200	+20,100		
共通担保(全店)			▲2,300	+4,500	+4,000
CP等買入	▲100		▲100		
国債補充供給	+1,100	▲4,400	+4,400		
新型コロナ対応金融支援特別				▲58,200	
当座預金増減		+4,500	+32,300	▲53,000	
当座預金残高		5,648,300	5,680,600	5,627,600	
準備預金残高		4,959,300			主な需給要因
積み終了先		4,958,900			
超過準備		4,958,900			
非準備預金残高		689,000			
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

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(4/27~)	5,000	16,271	5,002	0.002	0.004	23.2
国債買入(4/27~)						
3~5年	4,750	8,568	4,756	0.000	0.001	81.9
5~10年	5,000	13,592	5,009	▲0.003	▲0.002	71.3
25年~	500	2,624	505	▲0.019	▲0.019	44.4
物価連動	600	2,781	601	▲0.400	▲0.478	55.0
米ドル資金供給(4/28~5/12)						
0	0	0.800	0.800			
国債補充供給(4/26~4/27)						
4,442	4,442	▲0.350	▲0.366			
0	0					
共通担保(全店)(4/27~5/11)						
20,000	4,450	4,450				

マネタリーベース (億円)
4月25日時点 6,897,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,709,200
4月27日以降の残り所要	
積数	2,600
平均	100

国庫短期証券入札予定

5月6日	3ヶ月
5月9日	6ヶ月
5月13日	3ヶ月
5月19日	1年
4月27日	2年
5月10日	10年
5月12日	30年
5月16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	4月4日	-
1年超3年以下	4750	4,750	4 8 13 20	4月20日	0
3年超5年以下	4750	4,750	4 8 20 26	4月26日	0
5年超10年以下	5000	5,000	8 13 20 26	4月26日	0
10年超25年以下	1250	1,250	4 20	4月20日	0
25年超	500	500	13 26	4月26日	0
物価連動債	600	600	月1回	4月26日	-
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	-

1年前の市場推移

○2021年4月積み期 [4月16日~5月14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