



短期市場の推移

	4月22日	4月25日	4月26日	4月27日
加重平均金利	▲0.015	▲0.016	▲0.017	▲0.018
東京レポレート(TN)	▲0.094	▲0.131	▲0.159	▲0.191
無コール残	169,210	167,922	172,327	182,035
ON	95,062	83,834	88,369	106,382
その他	74,148	84,088	83,958	75,653
有コール残	31,527	31,732	22,237	22,713

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	▲0.086	0.001	▲0.021	▲0.128
T/N	▲0.015	0.001	▲0.007	▲0.148
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.144
2W	▲0.035	0.100	▲0.028	▲0.142
3W	-	-	▲0.015	▲0.139
1M	▲0.008	0.000	▲0.005	▲0.140
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.111

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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)4月ISM製造業景況指数	57.5
-	-	-	-
-	-	-	-

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

4日積みとなる本日の無担保コールON物は▲0.015%の出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.010%の水準で取引された。昨日に引き続き一部の調達サイドにおいてニーズの減退がみられ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.021%となった。本日開催された金融政策決定会合では金融政策の現状維持が決定され、指値オペについては明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施することとした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.030 ~ ▲0.030	▲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大きな動向変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	4月28日		5月2日		5月6日
券	▲2,600		+500		+3,000
財政	+1,000		▲21,500		+500
過不足	▲1,600		▲21,000		+3,500
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入					
CP等買入	▲1,900	+4,000	▲100		
国債補完供給	+5,100	▲5,800	+5,800		
新型コロナ対応金融支援特別	▲58,200	+2,400			
当座預金増減	▲56,000		▲9,500		+3,500
当座預金残高	5,621,800		5,612,300		5,615,800
準備預金残高	4,922,800		主な需給要因		
積み終了先	4,922,400		国債発行・償還		
超過準備	4,922,400		(2年)		
非準備先残高	699,000				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	53.3%				
乖離率	46.6%				

4月28日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補完供給(4/28~5/2)	5,811	5,811	▲0.450	▲0.471
	0	0		
国債買入(固定利回り方式)(残存5年超10年以下)(5/2~)	5,816	5,816		
	0	0		

マネタリーベース (億円)
4月27日時点 6,937,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,709,200
5月2日以降の残り所要	
積数	600
平均	0

国債短期証券入札予定

5月6日	3ヶ月(第1077回)
5月9日	6ヶ月
5月13日	3ヶ月
5月19日	1年

国債入札予定

5月10日	10年
5月12日	30年
5月16日	物価連動
5月18日	5年

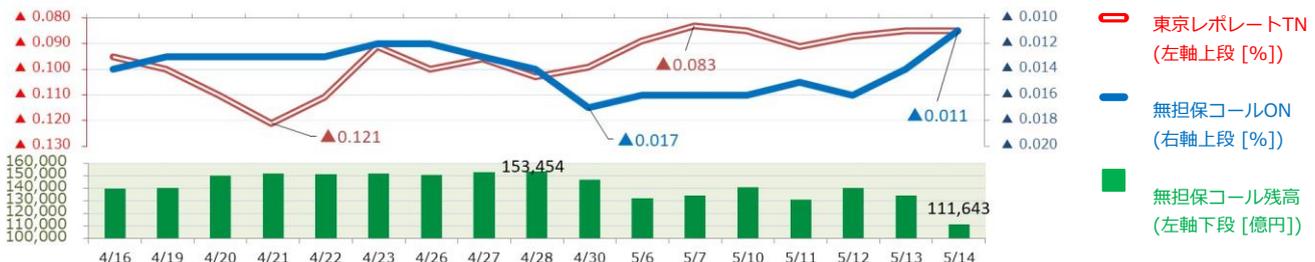
来月の国債買入オペ予定

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	4月4日	-
1年超3年以下	4750	4,750	9 13 19 25	4月20日	0
3年超5年以下	4750	4,750	9 13 25 30	4月26日	0
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 30	4月26日	0
10年超25年以下	1250	1,250	9 25	4月20日	0
25年超	500	500	19 30	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