



短期市場の推移

	4月23日	4月24日	4月25日	4月26日
加重平均金利	0.076	0.077	0.077	0.077
東京レボレート(TN)	0.068	0.031	0.013	0.012
無コール残	73,130	78,557	78,302	79,366
ON	30,307	34,364	33,759	35,843
その他	42,823	44,193	44,543	43,523
有コール残	36,717	36,338	37,315	35,711

[億円] [%]

5月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
13:00 日銀当座預金増減要因と金融調節 (4月)		(米) FOMC (2日目)	
		(米)パウエルFRB議長の会見	
		(米)製造業PMI (4月・確報)	

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

本日の市況

	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	0.050	0.078	0.076	0.001
T/N	-	-	-	0.008
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.025
2W	-	-	0.170	0.031
3W	-	-	-	0.031
1M	-	-	0.180	0.033
2M	-	-	0.130	-
3M	0.180	0.580	0.194	0.051
6M	-	-	-	0.075
1Y	-	-	-	0.113

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。月末要因により調達を見送る動きがあったため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.001%低下の0.076%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

取り控えていた先の調達再開が想定されるため、出合の水準は本日対比若干の上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月30日	5月1日	4月30日	5月1日	4月30日	5月1日
券		▲900		▲800		+0
財政		+8,500		+75,600		+33,000
過不足		+7,600		+76,400		+33,000
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
共通担保(全店)			▲7,000	+6,500		
CP等買入	▲1,300	+4,000	▲700			
国債補完供給	+32,400	▲38,900	+38,900			
当座預金増減		+3,800		+38,700		+33,000
当座預金残高		5,703,400		5,664,700		5,631,700
準備預金残高		5,021,700				
積み終了先		5,021,600				
超過準備		5,021,600				
非準備先残高		681,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		50.0%				
乖離率		49.9%				

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
米ドル資金供給(5/2~5/9)		0	0	5.580	5.580	
国債補完供給(4/30~5/1)		39,552	39,552	▲0.250	▲0.250	
共通担保(全店)(5/1~5/15)		220	220	▲0.250	▲0.250	
国債補完供給		8,000	6,510	6,510		

マナタリーベース	所要
4月26日時点	6,957,900
今積期の所要準備額	3,955,000
5月1日以降の残り所要	
積数	700
平均	0

国庫短期証券入札予定

5月2日	3ヶ月(第1228回)
5月9日	6ヶ月
5月10日	3ヶ月
5月16日	1年
5月8日	10年
5月10日	30年
5月14日	5年
5月16日	20年

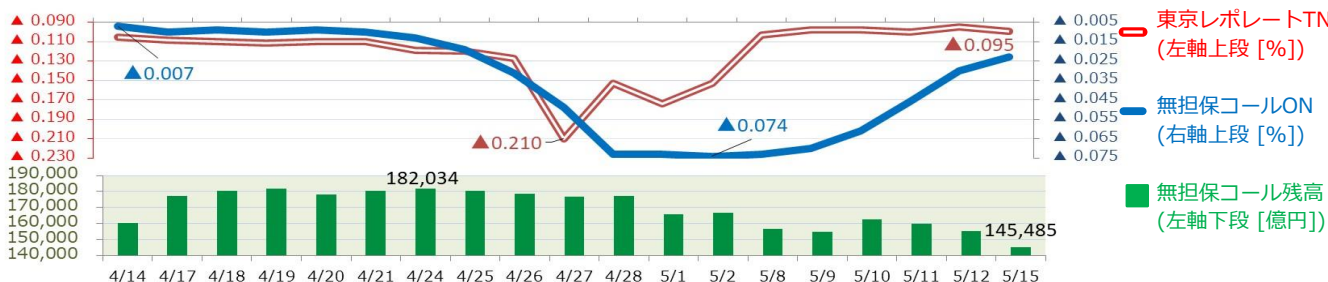
来月の国債買入オペ予定

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3日	1
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7 13 17 23	4月17日	4
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	7 17 23 31	4月24日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,750	13 17 23 31	4月24日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 13 31	4月24日	3
25年超	500~1,000	750	17 31	4月24日	2
物価連動債	600	600	月1回	4月24日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2023年4月積み期 [4月14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。