



短期市場の推移

	4月14日	4月15日	4月18日	4月19日
加重平均金利	▲0.013	▲0.016	▲0.019	▲0.017
東京レボレート(TN)	▲0.145	▲0.106	▲0.091	▲0.094
無コール残	171,256	135,837	144,410	152,579
ON	91,723	69,924	81,742	80,276
その他	79,533	65,913	62,668	72,303
有コール残	26,392	31,536	31,464	31,025

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	▲0.016	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.096
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	▲0.015	▲0.012	▲0.013	▲0.097
2W	▲0.010	0.001	▲0.006	▲0.102
3W	-	-	▲0.015	▲0.103
1M	▲0.020	▲0.012	▲0.018	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	21:30 (米)4月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	20.5
-	-	23:00 (米)3月景気先行指数	0.3%

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▲0.015%~▲0.010%の水準で取引された。昨日に引き続き様々な業態での資金調達ニーズが強く、本日の同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.016%(速報)となった。日本銀行は本日、固定利回り方式の国債買入をオファーし、また4/21~4/26における連続指値オペの実施も通知した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.023 ~ ▲0.020	▲0.015 ~ ▲0.013	▲0.018 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は引き続き強く、出合の水準は本日対比、若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月20日	4月21日	4月21日	4月22日	4月22日	4月23日
券	▲1,200	▲2,200	▲2,200	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲21,400	+1,700	+1,700	▲2,000	▲2,000	▲2,000
過不足	▲22,600	▲500	▲500	▲4,000	▲4,000	▲4,000
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
国債買入				+18,300		
CP等買入	▲100					
社債等買入	▲200	+1,000	▲100			
国債補充供給	+600					
当座預金増減	▲21,300	+17,700	+17,700	▲4,000	▲4,000	▲4,000
当座預金残高	5,640,000	5,657,700	5,657,700	5,653,700	5,653,700	5,653,700
準備預金残高	4,957,500					
積み終了先	4,956,900					
超過準備	4,956,800					
非準備先残高	682,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	16.7%					
乖離率	83.2%					

4月20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
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(4/21~)

1~3年	4,750	12,603	4,755	0.006	0.009	29.1
3~5年	4,750	11,050	4,755	0.007	0.008	22.1
5~10年	5,000	12,020	5,009	0.010	0.012	68.4
10~25年	1,250	3,774	1,257	0.016	0.017	48.0
国債買入(固定利回り方式)(残存5年超10年以下)(4/21~)	2,251	2,251				

国債補充供給(4/20~4/21)

13	13	▲0.350	▲0.350
0	0		

マネタリーベース [億円]

4月19日時点 6,908,400

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,709,200
4月21日以降の残り所要	
積数	5,400
平均	200

国庫短期証券入札予定

4月21日	6ヶ月(第1075回)
4月22日	3ヶ月(第1076回)
5月6日	3ヶ月
5月9日	6ヶ月
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

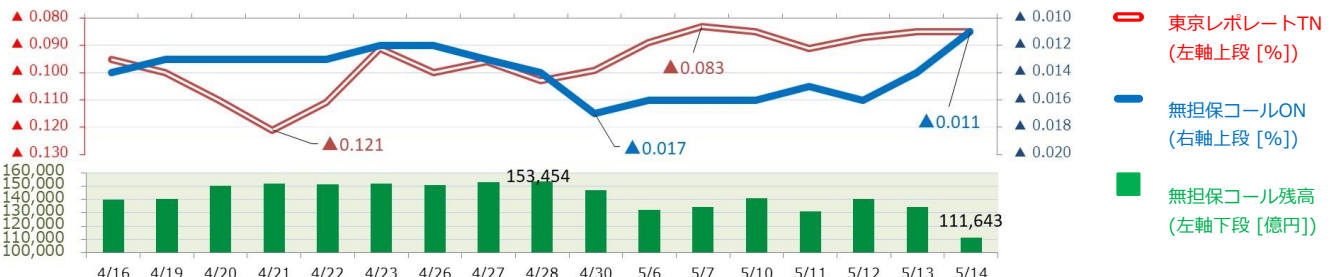
今月の国債買入オペ予定

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20日	1
5年超10年以下	5000	5,000	8 13 20 26	4月20日	1
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13日	1
物価連動債	600	600	月1回	3月30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