



## デイリーシグナル

2022年4月21日(木)

### 短期市場の推移

	4月15日	4月18日	4月19日	4月20日
加重平均金利	▲0.016	▲0.019	▲0.017	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.106	▲0.091	▲0.094	▲0.096
無コール残	135,837	144,410	152,579	159,689
ON	69,924	81,742	80,276	80,156
その他	65,913	62,668	72,303	79,533
有コール残	31,536	31,464	31,025	30,762

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	▲0.055	0.001	▲0.016	▲0.091
T/N	-	-	▲0.010	▲0.095
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	▲0.015	▲0.010	▲0.011	▲0.098
2W	▲0.015	0.005	▲0.009	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	▲0.010	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.111
1Y	-	-	-	▲0.112

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

### 4月22日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	3月消費者物価コア指数[前年比]	+0.8%	22:45	(米)4月製造業購買部担当者指数(PMI)	58.0
	-			-	
	-			-	

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▲0.013%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.010%の水準で取引された。昨日と同様の水準で取引され、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.016%(速報)となった。

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

週末3日積みのため、一部ビッドサイドの調達意欲が強まり、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21日	4月22日	4月22日	4月25日	4月25日	4月25日
券	▲2,200		▲1,400		▲2,000	
財政	▲4,700		+13,600		▲18,000	
過不足	▲6,900		+12,200		▲20,000	
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			▲200			
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給		▲200	+200			
当座預金増減	+11,100		+12,100		▲20,000	
当座預金残高	5,651,100		5,663,200		5,643,200	
準備預金残高	4,970,100		主な需給要因			
積み終了先	4,969,600		流動性供給	国庫短期証券		
超過準備	4,969,600			発行・償還(3M)		
非準備先残高	681,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	20.0%					
乖離率	79.9%					

### 4月21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
国債補完供給(4/21~4/22)	62	62	▲0.350	▲0.350		
	100	100	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]  
4月20日時点 6,888,200

所要	今積期の所要準備額	4月22日以降の残り所要
	3,709,200	
	積数	4,800
	平均	200

### 国庫短期証券入札予定

4月22日	3ヶ月(第1076回)
5月6日	3ヶ月
5月9日	6ヶ月
5月13日	3ヶ月

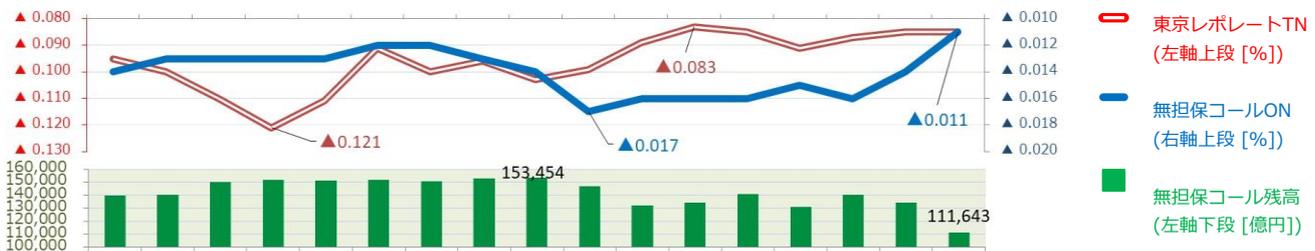
### 今月の国債買入オペ予定

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