



短期市場の推移

	4月7日	4月10日	4月11日	4月12日
加重平均金利	▲0.005	▲0.006	▲0.007	▲0.006
東京レポレート(TN)	▲0.144	▲0.149	▲0.120	▲0.098
無コール残	166,245	167,756	168,352	174,445
ON	91,559	92,220	92,146	96,479
その他	74,686	75,536	76,206	77,966
有コール残	27,524	26,371	25,318	28,200

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	▲0.006	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.132
2W	▲0.018	▲0.007	▲0.013	▲0.141
3W	-	-	▲0.015	▲0.154
1M	-	-	▲0.010	▲0.159
2M	-	-	-	-
3M	0.004	0.028	0.018	▲0.168
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.099

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)3月小売売上高	-0.4%
-	-	23:00 (米)4月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	64.0
-	-	-	-

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▲0.004%の合出から始まり、その後は主に▲0.008%~ ▲0.003%の水準で取引された。オファービッドの動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.005 ~ ▲0.004	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.008 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

新積み期にかかる3日積みとなるが、資金調達ニーズは堅調なため合い水準は横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月13日		4月14日		4月17日	
債券	▲500		+0		+0	
財政	▲6,500		+77,500		+11,500	
過不足	▲7,000		+77,500		+11,500	
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
CP等買入	▲100	+4,000	▲300			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+46,100	▲45,000	+45,000			
当座預金増減	▲2,100		+122,200		+11,500	
当座預金残高	5,414,000		5,536,200		5,547,700	
準備預金残高	4,727,300		主な需給要因			
積み終了先	4,727,200		年金定時払い		国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,727,200		流動性供給		個人向け国債発行・償還	
非準備先残高	686,700		各種財政資金の支払			
準備預金進捗率	100.0%					
平均	93.5%					
乖離率	6.5%					

4月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(4/14~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(4/17~4/24)						
	0	0	5,080	5,080		
国債補完供給(4/13~4/14)						
	870	870	▲1,100	▲1,325		
	44,285	44,285	▲0,350	▲0,351		
	0	0				

マネタリーベース (億円) 4月12日時点 6,679,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,918,900
4月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

4月14日	3ヶ月(第1151回)
4月19日	1年(第1152回)
4月21日	3ヶ月
5月2日	3ヶ月

国債入札予定

4月20日	20年
4月26日	2年
5月9日	10年
5月11日	30年

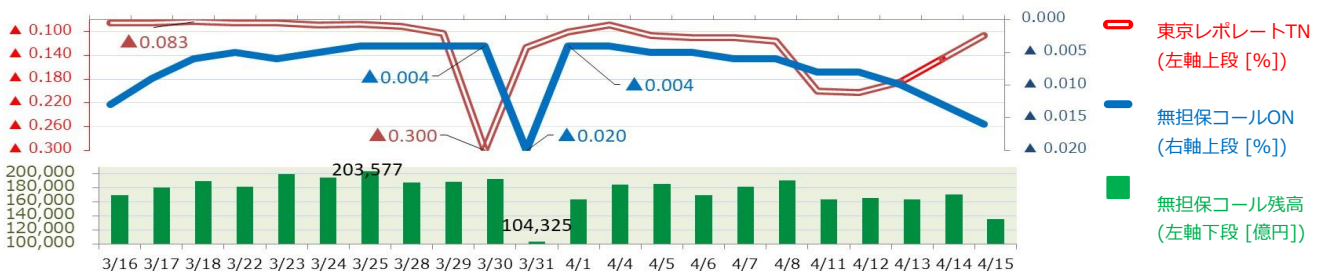
今月の国債買入オペ予定

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5日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 21	4月10日	2
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	5 14 21 27	4月5日	3
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	10 14 21 27	4月10日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,500	5 10 21 27	4月10日	2
25年超	500~3,500	1,000	10 14 24	4月10日	2
物価連動債	600	600	月1回	3月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	1

1年前の市場推移

○2022年3月積み期 [3月16日~4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。 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