



短期市場の推移

	4月14日	4月17日	4月18日	4月19日
加重平均金利	▲0.007	▲0.010	▲0.009	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.105	▲0.108	▲0.110	▲0.111
無コール残	160,600	177,295	180,461	181,928
ON	87,724	103,719	103,325	101,862
その他	72,876	73,576	77,136	80,066
有コール残	25,454	27,356	24,839	26,663

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	▲0.047	0.001	▲0.009	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.018	▲0.124
2W	▲0.040	▲0.018	▲0.033	▲0.142
3W	-	-	-	▲0.149
1M	0.011	0.020	0.013	▲0.154
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.099

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
8:30	3月消費者物価コア指数[前年比]	+3.0%		-	
				-	
				-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.008%の割合から始まり、その後は主に▲0.012%~ ▲0.007%の水準で取引された。市場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+0.001%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.008	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため資金調達ニーズは強くなるが、ビッドサイド動向に大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばい圏と予想。

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24日	4月24日
券	▲1,300	▲600	▲600	▲600		+0
財政	+3,800	▲7,700	▲7,700	▲7,700		+2,000
過不足	+2,500	▲8,300	▲8,300	▲8,300		+2,000
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
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入			▲300			
国債補完供給	+29,400	▲30,200	+30,200			
当座預金増減		+1,500	+22,400			+2,000
当座預金残高		5,529,600	5,552,000			5,554,000
準備預金残高		4,816,300				
積み終了先		4,811,400				
超過準備		4,810,300				
非準備先残高		713,300				
準備預金進捗率		99.2%				
平均		16.7%				
乖離率		82.5%				

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(固定利回り方式)(4/21~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(4/24~5/1)						
	0	0	5,080	5,080		
国債補完供給(4/20~4/21)						
	30,338	30,338	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
4月19日時点 6,792,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,846,600
4月21日以降の残り所要	
積数	30,700
平均	1,200

国庫短期証券入札予定

4月21日	3ヶ月(第1153回)
5月2日	3ヶ月
5月9日	6ヶ月
5月12日	3ヶ月
4月26日	2年
5月9日	10年
5月11日	30年
5月15日	5年

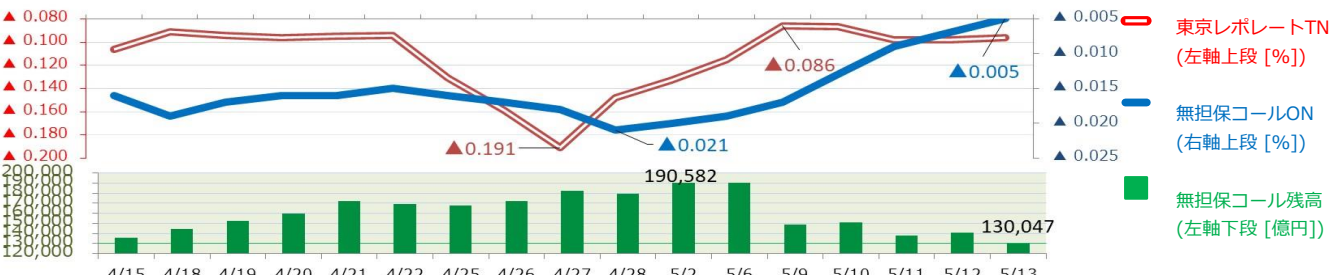
今月の国債買入オペ予定

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14日	1
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	5 14 21 27	4月14日	2
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	10 14 21 27	4月14日	2
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14日	1
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	4月14日	1

1年前の市場推移

○2022年4月積み期 [4月15日~5月13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