



短期市場の推移

	4月17日	4月18日	4月19日	4月20日
加重平均金利	▲0.010	▲0.009	▲0.010	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.108	▲0.110	▲0.111	▲0.110
無コール残	177,295	180,461	181,928	178,329
ON	103,719	103,325	101,862	97,533
その他	73,576	77,136	80,066	80,796
有コール残	27,356	24,839	26,663	26,706

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	▲0.047	0.001	▲0.010	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.023	▲0.127
2W	▲0.018	0.031	▲0.009	▲0.141
3W	-	-	-	▲0.148
1M	-	-	-	▲0.153
2M	-	-	▲0.006	-
3M	0.004	0.480	0.019	▲0.163
6M	-	-	-	▲0.131
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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		海外	
	予想		予想
	-		-
	-		-
	-		-

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▲0.008%の割合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.007%の水準で取引された。週末3日積みだが、ビッドサイ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▲0.001%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.008	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

オファービッド動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日対比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21日		4月24日		4月25日	
債券	▲700		▲900		▲2,000	
財政	▲8,100		+8,700		+12,500	
過不足	▲8,800		+7,800		+10,500	
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
国債買入						
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入	▲300	+1,000				
国債補完供給	+30,200	▲27,800	+27,800			
当座預金増減	▲5,900		+54,000		+10,500	
当座預金残高	5,523,700		5,577,700		5,588,200	
準備預金残高	4,816,400		主な需給要因			
積み終了先	4,813,500		国庫短期証券発行・償還 (3M)			
超過準備	4,812,600		各種財政資金の支払			
非準備先残高	707,300		い			
準備預金進捗率	99.5%					
平均	26.7%					
乖離率	72.8%					

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
国債買入(固定利回り方式)(4/24~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(4/24~)						
1~3年	4,250	11,864	4,255	0.004	0.005	69.3
3~5年	5,000	8,552	5,005	▲0.009	▲0.007	48.2
5~10年	6,750	13,447	6,755	▲0.010	▲0.007	12.9
10~25年	2,500	5,246	2,502	▲0.007	▲0.003	96.9
米ドル資金供給(4/25~5/11)						
	0	0	5,140	5,140		
国債補完供給(4/21~4/24)						
	28,032	28,032	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナターリベース (億円)	所要 (億円)
4月20日時点 6,795,200	今積期の所要準備額 3,846,600
	4月24日以降の残り所要
	積数 19,400
	平均 900

国庫短期証券入札予定

5月2日	3ヶ月
5月9日	6ヶ月
5月12日	3ヶ月
5月18日	1年
4月26日	2年
5月9日	10年
5月11日	30年
5月15日	5年

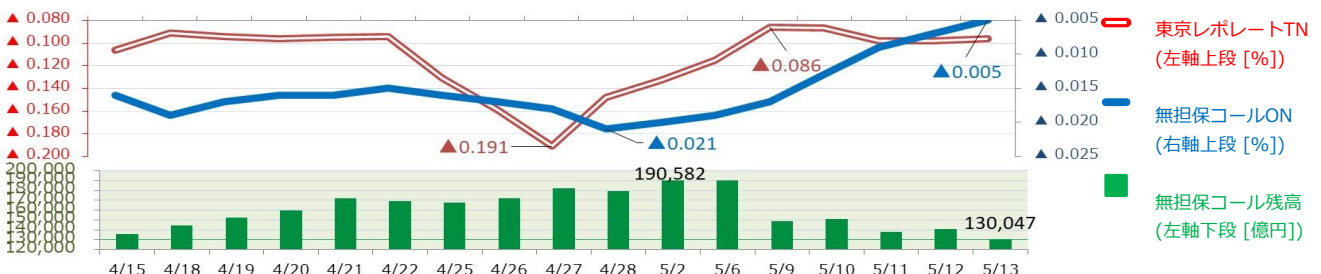
今月の国債買入オペ予定

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21日	0
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	5 14 21 27	4月21日	1
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	10 14 21 27	4月21日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	2,500	5 10 21 27	4月21日	1
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	0

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