



短期市場の推移

	4月20日	4月21日	4月24日	4月25日
加重平均金利	▲0.009	▲0.010	▲0.013	▲0.019
東京レポレート(TN)	▲0.110	▲0.110	▲0.119	▲0.120
無コール残	178,329	180,408	182,034	180,370
ON	97,533	99,862	102,713	99,779
その他	80,796	80,546	79,321	80,591
有コール残	26,706	24,686	24,134	25,772

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	▲0.060	0.001	▲0.031	▲0.103
T/N	-	-	-	▲0.127
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.020	▲0.030	▲0.156
2W	▲0.016	0.040	0.009	▲0.156
3W	-	-	-	▲0.158
1M	-	-	0.180	▲0.162
2M	▲0.010	▲0.008	▲0.009	-
3M	-	-	0.001	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.102

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (28日まで)		21:30 (米)1-3月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	2.0%
-		21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-		-	-

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~ ▲0.028%の水準で取引された。調達ニーズが一層弱まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.012%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.028

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズは弱く、出合の水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月26日	4月27日	4月26日	4月27日	4月26日	4月27日
券	▲2,000	▲2,900	▲2,000	▲2,900	▲2,700	▲2,700
財政	▲20,100	+2,400	▲20,100	+2,400	+2,200	+2,200
過不足	▲22,100	▲500	▲22,100	▲500	▲500	▲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
国庫短期証券買入	+1,000					
CP等買入	▲400	▲200	▲400	▲200		+4,000
社債等買入		▲300		▲300		
国債補完供給	+25,300	+26,500	+26,500	+26,500		
新型コロナ対応金融支援特別		▲2,500		▲2,500		
当座預金増減	▲22,700	+23,000	▲22,700	+23,000	+3,500	+3,500
当座預金残高	5,532,100	5,555,100	5,532,100	5,555,100	5,558,600	5,558,600
準備預金残高	4,815,900	主な需給要因				
積み終了先	4,814,300					
超過準備	4,814,300					
非準備先残高	716,200					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	36.7%					
乖離率	63.0%					

4月26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)(4/27~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
米ドル資金供給(4/28~5/11)						
	0	0	5,180	5,180		
国債補完供給(4/26~4/27)						
	26,689	26,689	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
4月25日時点 6,823,700	今積期の所要準備額 3,846,600
	4月27日以降の残り所要積数 12,300
	平均 600

国債短期証券入札予定

5月2日	3ヶ月(第1154回)
5月9日	6ヶ月
5月12日	3ヶ月
5月18日	1年

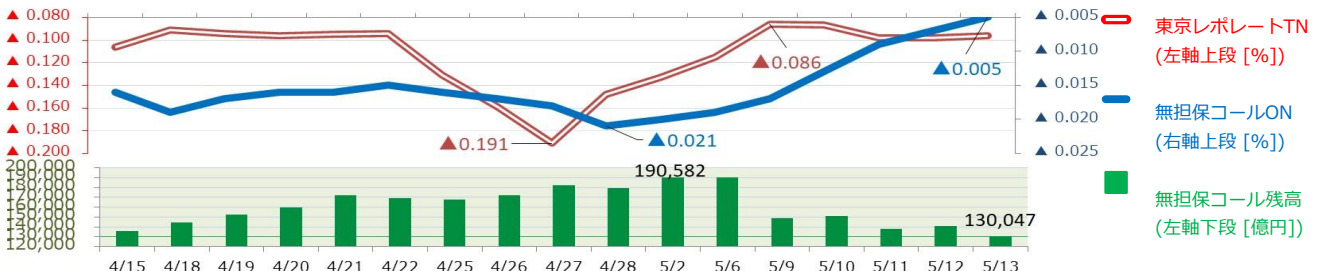
今月の国債買入オペ予定

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