



短期市場の推移

	4月24日	4月25日	4月26日	4月27日
加重平均金利	▲0.013	▲0.019	▲0.031	▲0.049
東京レポレート(TN)	▲0.119	▲0.120	▲0.127	▲0.210
無コール残	182,034	180,370	178,594	176,805
ON	102,713	99,779	97,791	95,102
その他	79,321	80,591	80,803	81,703
有コール残	24,134	25,772	27,826	25,236

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	▲0.087	0.001	▲0.073	▲0.165
T/N	▲0.055	0.001	▲0.030	▲0.153
S/N	▲0.050	▲0.045	▲0.046	-
1W	-	-	▲0.043	▲0.167
2W	-	-	-	▲0.168
3W	-	-	-	▲0.169
1M	-	-	-	▲0.167
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.163
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

5月1日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)4月ISM製造業景況指数	46.8
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.070%の水準で取引された。調達ニーズが一層弱まったことで出合いの水準は低下し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.024%の▲0.073%となった。また、本日開催された日銀金融政策決定会合では政策の現状維持が決定され、金融政策運営について、1年から1年半程度の時間をかけて、多角的にレビューを行うこととした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

調達サイドの参加者に変化はみられるものの、出合いの水準は本日対比横ばいと想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月28日	5月1日	4月28日	5月1日	4月28日	5月1日
券	▲1,400	▲900	▲1,400	▲900	▲3,000	▲3,000
財政	+800	▲22,400	+800	▲22,400	+0	+0
過不足	▲600	▲23,300	▲600	▲23,300	▲3,000	▲3,000
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		+16,400				
CP等買入	▲2,900	+4,000				
社債等買入	▲400					
国債補完供給	+34,300	▲48,500	+48,500			
当座預金増減	+2,300	+25,200	+2,300	+25,200	▲3,000	▲3,000
当座預金残高	5,529,200	5,554,400	5,529,200	5,554,400	5,551,400	5,551,400
準備預金残高	4,798,800		4,798,800			
積み終了先	4,797,300		4,797,300			
超過準備	4,796,900		4,796,900			
非準備先残高	730,400		730,400			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	50.0%		50.0%			
乖離率	49.9%		49.9%			

4月28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)(5/1~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(5/2~5/11)						
	0	0	5,210	5,210		
国債補完供給(4/28~5/1)						
	48,740	48,740	▲0.450	▲0.450		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
4月27日時点 6,800,600

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,846,600
5月1日以降の残り所要
積数 5,000
平均 300

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

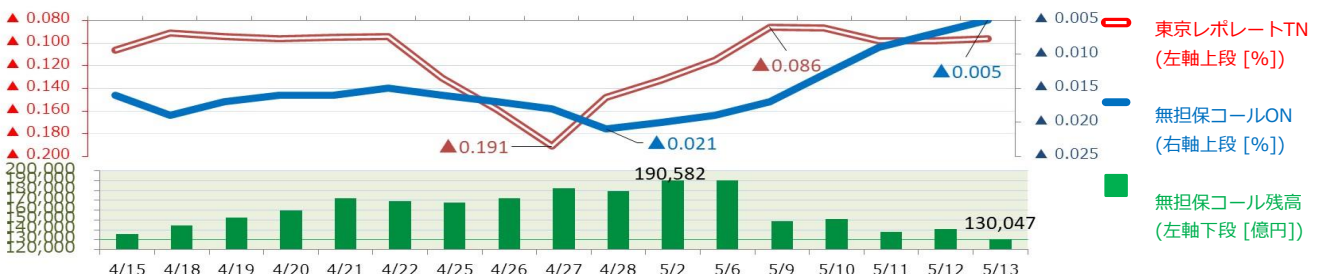
来月の国債買入オペ予定

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	8 12 18 24	4月21日	0
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	8 18 24 29	4月27日	0
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	12 18 24 29	4月27日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	2,500	8 12 24 29	4月27日	0
25年超	500~3,500	1,000	12 18 29	4月27日	0
物価連動債	600	600	月1回	4月27日	0
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