



短期市場の推移

	4月25日	4月26日	4月27日	4月28日
加重平均金利	▲0.019	▲0.031	▲0.049	▲0.073
東京レポレート(TN)	▲0.120	▲0.127	▲0.210	▲0.153
無コール残	180,370	178,594	176,805	177,458
ON	99,779	97,791	95,102	101,020
その他	80,591	80,803	81,703	76,438
有コール残	25,772	27,826	25,236	23,000

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	▲0.134
T/N	▲0.065	0.001	▲0.038	▲0.174
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.030	▲0.055	▲0.171
2W	▲0.050	0.000	▲0.030	▲0.169
3W	-	-	-	▲0.171
1M	-	-	0.000	▲0.170
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.022	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.130
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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧)4月消費者物価コア指数[前年比]	5.6%上昇
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.075%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.070%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)は前営業日対比横ばいの▲0.073%となった。

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

翌営業日のマーケット

大型連休を跨ぐ取引となり調達ニーズは底堅く、出合い水準は若干の上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月1日	5月2日	5月2日	5月8日	5月8日	5月8日
券	▲900	▲500	▲500	+2,000		
財政	▲22,800	▲15,500	▲15,500	▲42,000		
過不足	▲23,700	▲16,000	▲16,000	▲40,000		
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
国債補完供給	+48,500	▲44,100	+44,100			
当座預金増減	▲19,300	+28,100	+28,100	▲40,000		
当座預金残高	5,509,900	5,538,000	5,538,000	5,498,000		
準備預金残高	4,789,400	主な需給要因				
積み終了先	4,788,700	3M発行償還				
超過準備	4,788,500	税保険揚げ				
非準備先残高	720,500	社会保障費の支払い				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	53.3%					
乖離率	46.6%					

5月1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)(5/2~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(5/1~5/2)						
	44,120	44,120	▲0.450	▲0.451		
	0	0				

マネタリーベース (億円)

4月28日時点 6,804,400

所要

今積期の所要準備額	5月2日以降の残り所要	積数	平均
3,846,600		4,100	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
5月9日	10年
5月11日	30年
5月15日	5年
5月17日	20年

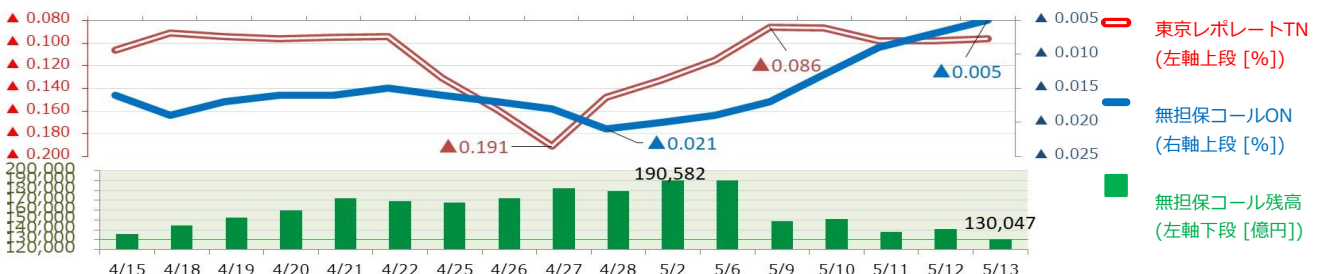
今月の国債買入オペ予定

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