



短期市場の推移

	3月28日	3月29日	3月30日	3月31日
加重平均金利	▲0.004	▲0.004	▲0.004	▲0.020
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.103	▲0.300	▲0.126
無コール残	187,893	189,313	193,389	104,325
ON	90,945	97,325	112,416	65,397
その他	96,948	91,988	80,973	38,928
有コール残	29,440	30,442	29,517	13,975

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	▲0.050	0.001	▲0.004	▲0.105
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.003	0.280	0.016	▲0.102
2W	▲0.025	▲0.001	▲0.009	▲0.102
3W	▲0.002	▲0.001	▲0.002	▲0.103
1M	▲0.005	0.000	▲0.003	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.200	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.103
1Y	-	-	-	▲0.108

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4日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	3月短観 (調査全容) (日銀)		-	
8:50	3月マネタリーベース (日銀)		-	
	-		-	

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▲0.003%の合出から始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.001%の水準で取引された。年度末に調達を控えていた先を中心に調達意欲が強まり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.016%の▲0.004%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.010 ~ ▲ 0.010	▲ 0.010 ~ ▲ 0.005	▲ 0.008 ~ ▲ 0.001

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの旺盛な調達ニーズは変わらず、出合の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月1日		4月4日		4月5日	
券	▲300		+700		+1,000	
財政	▲34,200		▲22,000		+3,000	
過不足	▲34,500		▲21,300		+4,000	
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
E T F 買入	+600		+600			
国債補完供給	+9,200	▲600	+600			
当座預金増減	▲25,300		▲20,700		+4,000	
当座預金残高	5,606,500		5,585,800		5,589,800	
準備預金残高	4,961,100		4,961,100		4,961,100	
積み終了先	4,961,100		4,961,100		4,961,100	
超過準備	4,961,100		4,961,100		4,961,100	
非準備先残高	645,400		645,400		645,400	
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%	
平均	61.3%		61.3%		61.3%	
乖離率	38.6%		38.6%		38.6%	

4月1日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補完供給(4/1~4/4)	634	634	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)

3月31日時点 6,880,400

所要

今積期の所要準備額	3,775,500
4月4日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

4月7日	6ヶ月(第1071回)
4月8日	3ヶ月(第1072回)
4月15日	3ヶ月
4月19日	1年

国債入札予定

4月5日	10年
4月7日	30年
4月12日	5年
4月14日	20年

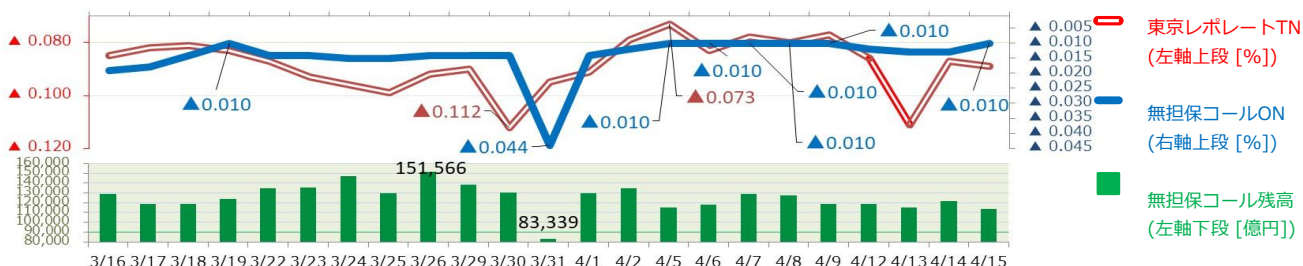
今月の国債買入オペ予定

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	3月2日	1
1年超3年以下	4750	4,500	4 8 13 20	3月23日	4
3年超5年以下	4750	6,000	4 8 20 26	3月30日	4
5年超10年以下	5000	5,000	8 13 20 26	3月30日	4
10年超25年以下	1250	1,000	4 20	3月30日	2
25年超	500	500	13 26	3月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	3月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月20日	-

1年前の市場推移

○2021年3月積み期 [3月16日~4月15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