



デイリーシグナル

2022年4月4日(月)

短期市場の推移

	3月29日	3月30日	3月31日	4月1日
加重平均金利	▲0.004	▲0.004	▲0.020	▲0.004
東京レボレート(TN)	▲0.103	▲0.300	▲0.126	▲0.101
無コール残	189,313	193,389	104,325	164,212
ON	97,325	112,416	65,397	83,959
その他	91,988	80,973	38,928	80,253
有コール残	30,442	29,517	13,975	29,279

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.055	0.001	▲0.004	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.003	▲0.002	▲0.003	▲0.093
2W	▲0.024	▲0.001	▲0.007	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.097
1M	▲0.010	▲0.002	▲0.006	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.150	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.104
1Y	-	-	-	▲0.110

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

4月5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (4月見込み) (日銀)		21:30	(米)2月貿易収支 -889億米ドル
	-			-
	-			-

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▲0.012%~▲0.001%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.004%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.012	▲0.003 ~ ▲0.003	▲0.003 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

一部調達を控える先が想定されるが影響は限定的なため、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4日	4月5日	4月6日
券	+700	+900	+100
財政	▲17,600	+3,900	▲26,000
過不足	▲16,900	+4,800	▲25,900
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		▲12,500	
国債補充供給	+600	▲2,600	+2,600
当座預金増減	▲18,900	+19,900	▲25,900
当座預金残高	5,587,600	5,607,500	5,581,600
準備預金残高	4,935,600		
積み終了先	4,935,600		
超過準備	4,935,600		
非準備先残高	652,000		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

4月4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(4/5~)						
~1年	1,500	5,226	1,503	▲0.003	▲0.001	92.8
1~3年	4,750	14,380	4,756	▲0.005	▲0.003	4.0
3~5年	4,750	12,524	4,752	▲0.006	▲0.004	50.1
10~25年	1,250	5,830	1,269	0.003	0.004	28.2
国債補充供給(4/4~4/5)						
	2,581	2,581	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
4月1日時点 6,855,400

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,775,500
4月5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
4月5日	10年
4月7日	30年
4月12日	5年
4月14日	20年

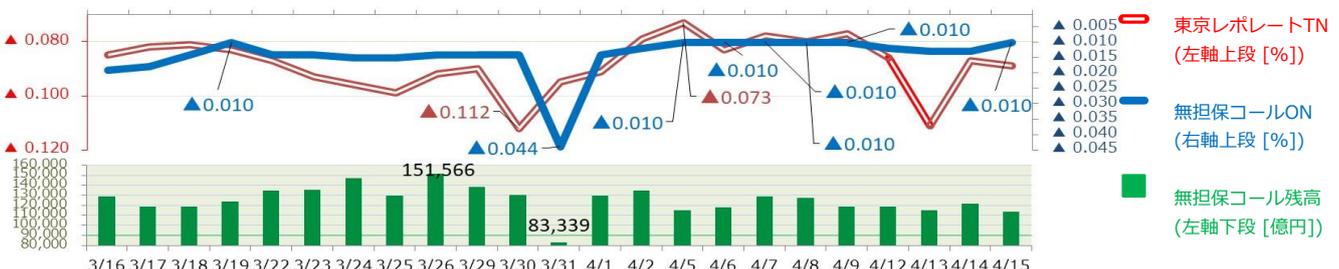
今月の国債買入オペ予定

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	4月4日	0
1年超3年以下	4750	4,750	4 8 13 20	4月4日	3
3年超5年以下	4750	4,750	4 8 20 26	4月4日	3
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	1,250	4 20	4月4日	1
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

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