上田八木短資

デイリーシグナル

2022年4月5日(火)

短期市場の推移 [億円] [%]

	3月30日	3月31日	4月1日	4月4日
加重平均金利	▲0.004	▲0.020	▲0.004	▲0.004
東京レポレート(TN)	▲0.300	▲0.126	▲0.101	▲0.089
無コール残	193,389	104,325	164,212	185,322
ON	112,416	65,397	83,959	97,834
その他	80,973	38,928	80,253	87,488
有コール残	29,517	13,975	29,279	30,177

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。

4月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			(米) MBA住宅ローン申請指数	
	-			(米) FOMC議事録(3月15,16日開催分)	
	-			-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.005	▲0.100
T/N	-	-	▲0.003	▲0.106
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	▲0.004	▲0.001	▲0.002	▲0.103
2W	▲0.005	0.100	0.013	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.105
1M	-	-	▲0.002	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.105
1Y	-	-	-	▲0.110

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.002%の出合から始まり、その後は主に▲0.01%～▲0.001%の水準で取引された。引き続き地銀業態を中心に積極的に調達を行われた中、一部の先では取り意欲の減退が見られ、同加重平均金利（速報）は前営業日対比▲0.001%の▲0.005%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ～ -	▲ 0.003 ～ ▲ 0.003	▲ 0.005 ～ ▲ 0.001

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日と横ばいか若干の低下を予想。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月5日		4月6日		4月7日	
券	+800		+400		▲1,000	
財政	+1,200		▲23,500		▲4,000	
過不足	+2,000		▲23,100		▲5,000	
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
国庫短期証券買入				+10,000		
国債買入		+12,500				
国債補完供給	+2,600	▲300	+300			
当座預金増減	+16,800		▲12,800		▲5,000	
当座預金残高	5,604,400		5,591,600		5,586,600	
準備預金残高	4,936,900		主な需給要因			
積み終了先	4,936,900		国債発行（１０年）		国債発行（３０年）	
超過準備	4,936,900					
非準預先残高	667,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

4月5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
国庫短期証券買入(4/6～)	10,000	26,774	10,007	0.000	0.003	39.0
米ドル資金供給(4/7～4/14)	0	0	0.590	0.590		
国債補完供給(4/5～4/6)	329	329	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

4月4日時点	6,835,500

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,775,500
4月6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

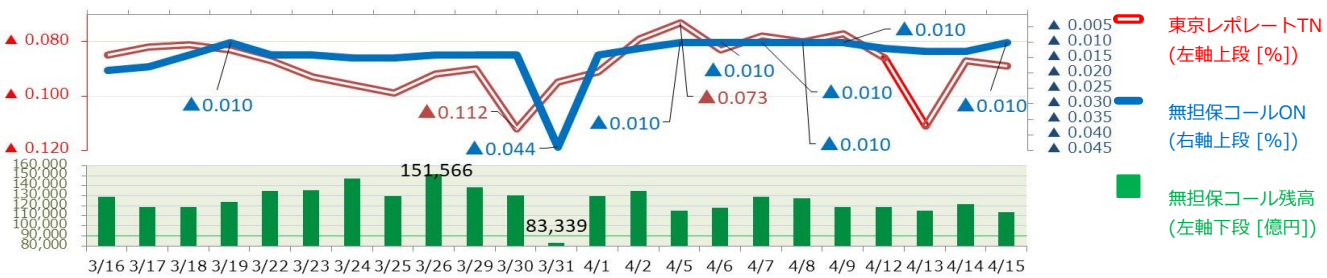
4月7日	30年
4月12日	5年
4月14日	20年
4月27日	2年

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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