



短期市場の推移

	4月4日	4月5日	4月6日	4月7日
加重平均金利	▲0.004	▲0.005	▲0.005	▲0.006
東京レポレート(TN)	▲0.089	▲0.106	▲0.110	▲0.110
無コール残	185,322	185,497	170,449	181,825
ON	97,834	100,549	88,761	99,967
その他	87,488	84,948	81,688	81,858
有コール残	30,177	30,245	30,751	31,371

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	▲0.060	0.001	▲0.006	▲0.106
T/N	-	-	-	▲0.116
S/N	-	-	▲0.001	-
1W	▲0.010	0.005	▲0.008	▲0.116
2W	-	-	-	▲0.114
3W	-	-	-	▲0.115
1M	-	-	-	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.020	▲0.110
6M	-	-	-	▲0.108
1Y	-	-	-	▲0.112

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11日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	14:00	地域経済報告 (さくらレポート)		-
	-		-	
	-		-	

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▲0.005%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.003%の水準で取引された。週末3日積みみではあったが、ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.005 ~ ▲0.004	▲0.010 ~ ▲0.001

登営業日のマーケット

3日積み要因が剥落するため、出合の水準は横ばいないし若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月8日	4月11日	4月11日	4月12日	4月12日	4月12日
券	+600	+800	+800	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲5,800	▲7,800	▲7,800	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	▲5,200	▲7,000	▲7,000	+3,000	+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				+14,800		
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+300	▲1,600	+1,600			
当座預金増減	▲6,600	+9,400	+9,400	+3,000	+3,000	+3,000
当座預金残高	5,588,500	5,597,900	5,597,900	5,600,900	5,600,900	5,600,900
準備預金残高	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800
積み終了先	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800
超過準備	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800	4,924,800
非準備先残高	663,700	663,700	663,700	663,700	663,700	663,700
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	83.9%	83.9%	83.9%	83.9%	83.9%	83.9%
乖離率	16.1%	16.1%	16.1%	16.1%	16.1%	16.1%

4月8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

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(4/11~)						
1~3年	4,750	12,475	4,754	▲0.012	▲0.010	82.1
3~5年	4,750	9,037	4,755	▲0.009	▲0.007	58.8
5~10年	5,000	9,301	5,005	▲0.003	0.000	19.9
変動利付	300	443	300	▲1.400	▲1.423	

CP等買入(4/13~)

4,000 9,752 3,997 ▲0.008 ▲0.004 97.0

国債補完供給(4/8~4/11)

1,371 1,371 ▲0.350 ▲0.350

68 68 ▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース [億円]

4月7日時点 6,842,200

所要

今積期の所要準備額 3,789,900

4月11日以降の残り所要

積数 0

平均 0

国庫短期証券入札予定

4月15日	3ヶ月(第1073回)
4月19日	1年
4月21日	6ヶ月
4月22日	3ヶ月

国債入札予定

4月12日	5年
4月14日	20年
4月27日	2年
5月10日	10年

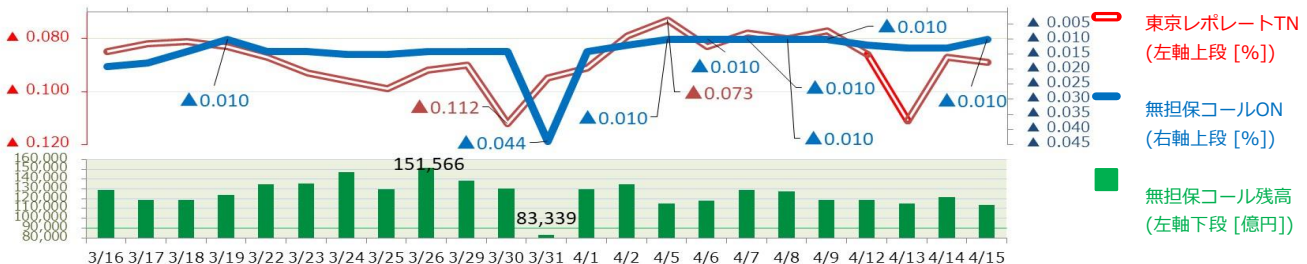
今月の国債買入オペ予定

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8日	2
3年超5年以下	4750	4,750	4 8 20 26	4月8日	2
5年超10年以下	5000	5,000	8 13 20 26	4月8日	3
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	4月8日	0

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