



短期市場の推移

	4月5日	4月6日	4月7日	4月8日
加重平均金利	▲0.005	▲0.005	▲0.006	▲0.006
東京レポレート(TN)	▲0.106	▲0.110	▲0.110	▲0.116
無コール残	185,497	170,449	181,825	191,111
ON	100,549	88,761	99,967	103,873
その他	84,948	81,688	81,858	87,238
有コール残	30,245	30,751	31,371	32,246

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	▲0.008	▲0.198
T/N	-	-	-	▲0.200
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	-	-	▲0.003	▲0.164
2W	-	-	-	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.138
1M	-	-	▲0.005	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.116
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.114

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12日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	国内企業物価指数[前年比]	+9.3%	21:30	(米)3月消費者物価コア指数[前年比]	6.6%
-	-	-	15:00	(英)3月失業率	-
-	-	-	15:00	(英)2月ILO失業率(3カ月)	3.8%

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▲0.004%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.003%の水準で取引された。積み期の最終週に入り一部では調達ニーズがやや減退し、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.008%となった。また日本銀行は4月積み期におけるマクロ加算残高算出に用いる基準比率を13.5%に定めることとした。

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

翌営業日のマーケット

地銀業態を中心に調達意欲の低下が見られ、出合の水準は本日対比で低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	4月11日		4月12日		4月13日
券	+800		+100		+0
財政	▲7,400		+2,500		▲32,000
過不足	▲6,600		+2,600		▲32,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+14,800			
共通担保(全店)					▲5,100
CP等買入					+4,000
国債補完供給	+1,600	▲1,500	+1,500		
当座預金増減	+8,300		+4,100		▲33,100
当座預金残高	5,596,800		5,600,900		5,567,800
準備預金残高	4,925,700		4,925,700		4,925,700
積み終了先	4,925,700		4,925,700		4,925,700
超過準備	4,925,700		4,925,700		4,925,700
非準備先残高	671,100		671,100		671,100
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%
平均	87.1%		87.1%		87.1%
乖離率	12.9%		12.9%		12.9%

4月11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(4/11~4/12)	1,468	1,468	▲0.350	▲0.356	0	0

マナタリーベース (億円)
4月8日時点 6,835,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,789,900
4月12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
4月12日	5年
4月14日	20年
4月27日	2年
5月10日	10年

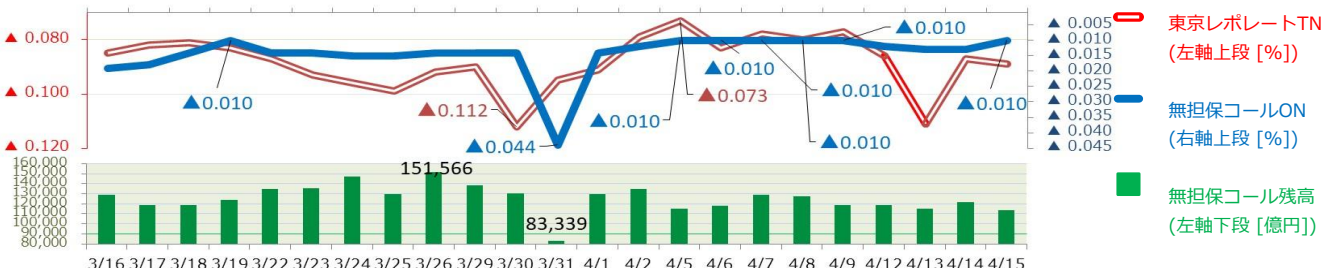
今月の国債買入オペ予定

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