



短期市場の推移

[億円] [%]

	4月6日	4月7日	4月8日	4月11日
加重平均金利	▲0.005	▲0.006	▲0.006	▲0.008
東京レボレート(TN)	▲0.110	▲0.110	▲0.116	▲0.200
無コール残	170,449	181,825	191,111	163,492
ON	88,761	99,967	103,873	76,764
その他	81,688	81,858	87,238	86,728
有コール残	30,751	31,371	32,246	26,216

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	▲0.060	0.001	▲0.008	▲0.200
T/N	-	-	-	▲0.202
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	-	-	-	▲0.173
2W	▲0.015	▲0.001	▲0.008	▲0.150
3W	-	-	-	▲0.138
1M	▲0.003	▲0.001	▲0.002	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲0.116
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.115

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月12日	4月13日	4月12日	4月13日	4月12日	4月13日
券						
財政	+2,200	▲30,800	+400	▲3,000	▲1,000	+3,000
過不足	+2,300	▲30,400	+2,000	▲2,000		
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				+5,000		
共通担保(全店)			▲5,100	+2,300		
CP等買入			▲300	+4,000		
国債補完供給	+1,500	▲300	+300			
当座預金増減	+3,500	▲24,200	+2,000			
当座預金残高	5,600,300	5,576,100	5,578,100			
準備預金残高	4,928,500					
積み終了先	4,928,500					
超過準備	4,928,500					
非準備先残高	671,800					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.3%					
乖離率	9.7%					

[億円]

4月12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(4/13~)

5,000 16,269 5,000 0.009 0.009

米ドル資金供給(4/14~4/21)

1 1 0.600 0.600

国債補完供給(4/12~4/13)

336 336 ▲0.450 ▲0.450

共通担保(全店)(4/13~4/27)

20,000 2,301 2,301

米ドル資金供給用担保国債供給(4/13~4/22)

5,000 2 2 ▲0.100 ▲0.100

マネタリーベース [億円]

4月11日時点 6,842,500

所要

今積期の所要準備額 3,789,900

4月13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(第1074回)
4月21日	6ヶ月
4月22日	3ヶ月

国債入札予定

4月14日	20年
4月27日	2年
2月1日	10年
2月3日	30年

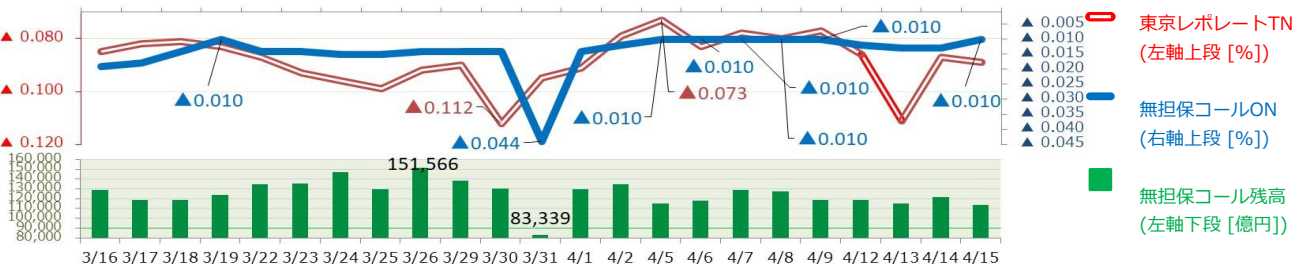
今月の国債買入オペ予定

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