



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	▲0.008	▲0.007	▲0.006	▲0.005
東京レポレート(TN)	▲0.107	▲0.111	▲0.131	▲0.144
無コール残	156,181	160,546	168,640	166,245
ON	86,620	90,360	95,604	91,559
その他	69,561	70,186	73,036	74,686
有コール残	30,924	30,460	29,506	27,524

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	▲0.055	0.001	▲0.006	▲0.116
T/N	-	-	-	▲0.149
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.008	▲0.003	▲0.007	▲0.164
2W	▲0.020	0.040	▲0.004	▲0.169
3W	-	-	-	▲0.174
1M	▲0.005	0.070	0.014	▲0.177
2M	-	-	-	-
3M	0.001	0.030	0.014	▲0.178
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.099

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)

日本	予想	海外	予想
-	-	19:00 (欧)2月小売売上高[前月比]	-0.8%
-	-	(米)フィラデルフィア連銀総裁講演	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.003%の割合から始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.003%の水準で取引された。前営業日対比一部ビットサイドの調達意欲は弱含み、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.006%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.005 ~ ▲0.004	▲0.004 ~ ▲0.004	▲0.006 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

ビットサイドの調達意欲は底堅いため、出合い水準は横ばい圏内と予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	4月10日	4月11日	4月11日	4月12日	4月12日
券		+700		+600	+0
財政		▲7,700		▲4,700	▲27,000
過不足		▲7,000		▲4,100	▲27,000
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				+14,600	
CP等買入	▲100		▲300		
E T F買入		+700			
国債補充供給	+36,000	▲54,400	+54,400		
当座預金増減		▲24,800		+64,600	▲27,000
当座預金残高		5,429,900		5,494,500	5,467,500
準備預金残高		4,734,000			
積み終了先		4,733,900			
超過準備		4,733,900			
非準備先残高		695,900			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		83.9%			
乖離率		16.0%			

4月10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
国債買入(固定利回り方式)(4/11~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(4/11~)						
1~3年	4,250	14,682	4,252	0.011	0.013	92.1
5~10年	6,750	15,386	6,764	0.006	0.008	90.8
10~25年	2,500	4,149	2,504	▲0.004	0.005	48.1
25年~	1,000	2,632	1,002	0.016	0.018	47.3
米ドル資金供給(4/12~4/19)						
	0	0	5,070	5,070		
CP等買入(4/13~)						
	4,000	6,435	3,995	0.002	0.011	8.7
国債補充供給(4/10~4/11)						
	874	874	▲1.100	▲1.382		
	53,529	53,529	▲0.350	▲0.351		
	140	140	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース (億円)
 4月7日時点 6,719,400

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,918,900
4月11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14日	3ヶ月(第1151回)
4月19日	1年
4月21日	3ヶ月
5月2日	3ヶ月
4月11日	5年
4月20日	20年
4月26日	2年
5月9日	10年

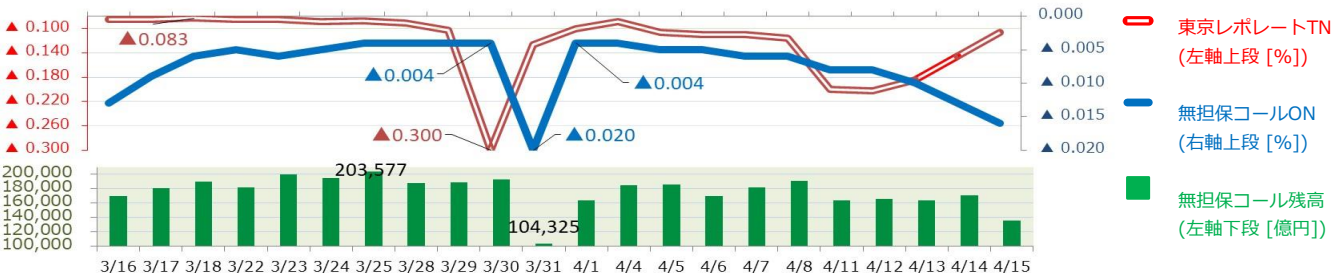
今月の国債買入オペ予定

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5日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 21	4月10日	2
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	5 14 21 27	4月5日	3
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	10 14 21 27	4月10日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,500	5 10 21 27	4月10日	2
25年超	500~3,500	1,000	10 14 24	4月10日	2
物価連動債	600	600	月1回	3月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	1月12日	1

1年前の市場推移

○2022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