



短期市場の推移

	4月5日	4月6日	4月7日	4月10日
加重平均金利	▲0.007	▲0.006	▲0.005	▲0.006
東京レポレート(TN)	▲0.111	▲0.131	▲0.144	▲0.149
無コール残	160,546	168,640	166,245	167,756
ON	90,360	95,604	91,559	92,220
その他	70,186	73,036	74,686	75,536
有コール残	30,460	29,506	27,524	26,371

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	▲0.055	0.001	▲0.007	▲0.102
T/N	-	-	-	▲0.120
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.005	▲0.032	▲0.160
2W	▲0.018	▲0.008	▲0.014	▲0.165
3W	-	-	-	▲0.172
1M	-	-	-	▲0.177
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.175
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12日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	3月国内企業物価指数[前年比]	+7.2%	21:30	(米)3月消費者物価コア指数[前年比]	5.6%
	-			-	
	-			-	

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▲0.003%の合出から始まり、その後は主に▲0.008%~ ▲0.003%の水準で取引された。一部ビッドサイドで調達意欲の弱まりも見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.007%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.008 ~ ▲0.005	▲0.004 ~ ▲0.004	▲0.007 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

オファービッド動向に大きな変化はなく、出合い水準は横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月11日	4月12日	4月11日	4月12日	4月11日	4月12日
券	+600	+200			▲2,000	
財政	▲7,300	▲27,200			+1,000	
過不足	▲6,700	▲27,000			▲1,000	
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				+1,000		
国債買入		+14,600				
CP等買入	▲300		▲400			+4,000
国債補完供給	+54,400	▲48,400	+48,400			
当座預金増減	+13,600	+22,000			+3,000	
当座預金残高	5,443,500	5,465,500	5,468,500			
準備預金残高	4,749,200					
積み終了先	4,749,200					
超過準備	4,749,200					
非準備先残高	694,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	87.1%					
乖離率	12.8%					

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
国庫短期証券買入(4/12~)	1,000	6,050	1,000	0.024	0.024	
国債買入(固定利回り方式)(4/12~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(4/13~4/20)	0	0	5,080	5,080		
国債補完供給(4/11~4/12)	785	785	▲1,100	▲1,375		
	47,614	47,614	▲0.350	▲0.351		
	200	200	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
4月10日時点 6,693,800

所要	今積期の所要準備額
4月12日以降の残り所要	3,918,900
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

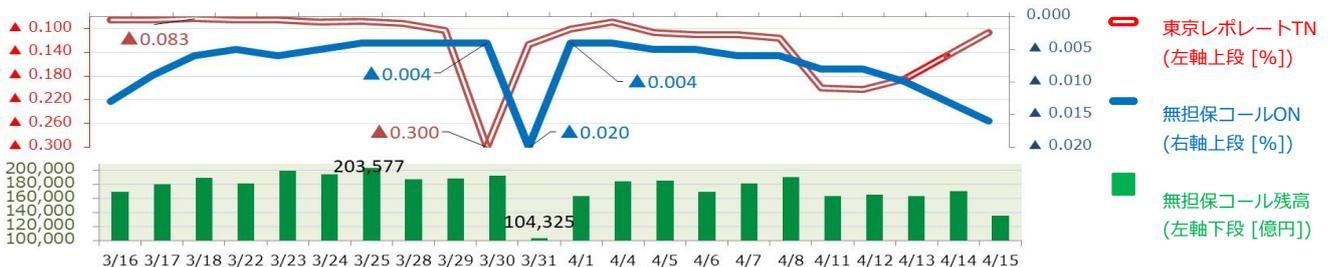
今月の国債買入オペ予定

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