



短期市場の推移

	4月6日	4月7日	4月10日	4月11日
加重平均金利	▲0.006	▲0.005	▲0.006	▲0.007
東京レポレート(TN)	▲0.131	▲0.144	▲0.149	▲0.120
無コール残	168,640	166,245	167,756	168,352
ON	95,604	91,559	92,220	92,146
その他	73,036	74,686	75,536	76,206
有コール残	29,506	27,524	26,371	25,318

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	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.000	▲0.005	▲0.137
2W	▲0.018	▲0.015	▲0.017	▲0.149
3W	-	-	-	▲0.161
1M	-	-	-	▲0.164
2M	-	-	-	-
3M	0.003	0.004	0.004	▲0.172
6M	-	-	-	▲0.130
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
-	-	-	21:30	(米)3月生産者物価コア指数[前年比]	3.5%
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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。ビッドサイドの調達意欲は底堅く、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	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.007 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッド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12日	4月13日	4月12日	4月13日	4月14日	4月15日
券		+100		▲500		▲1,000
財政		▲30,400		▲1,900		+80,000
過不足		▲30,300		▲2,400		+79,000
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				
CP等買入	▲400		▲100	+4,000		
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+48,400	▲46,100	+46,100			
当座預金増減		▲27,400		+47,500		+79,000
当座預金残高		5,416,100		5,463,600		5,542,600
準備預金残高		4,727,500	主な需給要因			
積み終了先		4,727,500	年金定時払い			
超過準備		4,727,500	流動性供給			
非準備先残高		688,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.3%				
乖離率		9.6%				

4月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(4/13~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(4/14~4/21)						
	0	0	5,070	5,070		
国債補完供給(4/12~4/13)						
	902	902	▲1,100	▲1,340		
	45,288	45,288	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナリーベース (億円)
4月11日時点 6,706,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,918,900
4月13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(第1152回)
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