



## デイリーシグナル

2024年4月11日(木)

短期市場の推移 [億円] [%]					4月12日の予定 (時刻は日本時間)				
	4月5日	4月8日	4月9日	4月10日	日本		海外		予想
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077	10:00	日本	営業毎旬報告 (4月10日現在)		予想
東京レポレート(TN)	0.054	0.042	0.032	0.048			-		予想
無コール残	86,466	84,252	83,141	85,473			-		予想
ON	48,723	46,609	44,948	46,650			-		予想
その他	37,743	37,643	38,193	38,823	-				
有コール残	33,609	35,010	30,951	35,932	-				

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	0.078	0.077	0.051
T/N	-	-	-	0.055
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.044
2W	-	-	0.170	0.043
3W	-	-	0.170	0.043
1M	-	-	0.190	0.040
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.185	0.053
6M	-	-	-	0.077
1Y	-	-	-	0.108

本日の市況

無担保コールON物は0.077%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.077%となった。

[%]		
都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

資金需給	[億円]					
	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月11日		4月12日		4月15日	
債券	+0		+300		+0	
財政	+2,300		▲4,000		+87,000	
過不足	+2,300		▲3,700		+87,000	
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
CP等買入	▲100		▲400			+4,000
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+35,800	▲35,300	+35,300			
当座預金増減	+2,600		+31,100		+91,000	
当座預金残高	5,586,300		5,617,400		5,708,400	
準備預金残高	4,908,800		主な需給要因			
積み終了先	4,908,800		国債発行(20年)		国庫短期証券発行償還(3M)	
超過準備	4,908,800		源泉税場上げ		国債発行償還(個人)	
非準備先残高	677,500		年金定時払い			
準備預金進捗率	100.0%					
平均	87.1%					
乖離率	12.9%					

4月11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
国債補完供給(4/11~4/12)	35,782	35,782	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

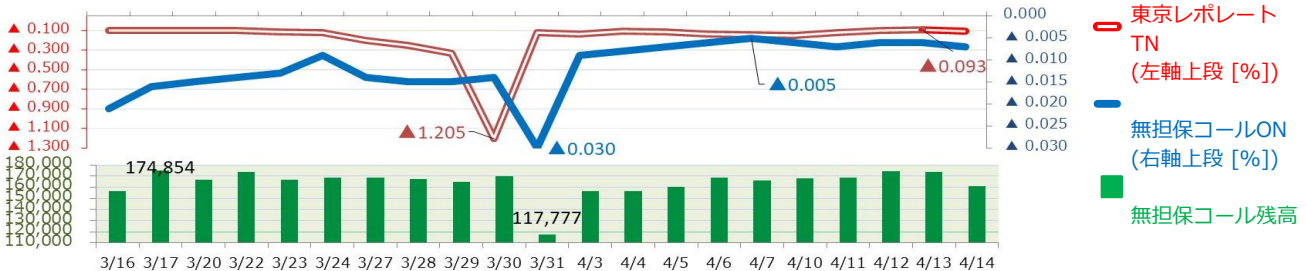
マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
4月10日時点 6,835,800	今積期の所要準備額 4,056,600
	4月12日以降の残り所要
	積数 0
	平均 0

国債短期証券入札予定	
4月12日	3ヶ月(第1225回)
4月18日	1年(第1226回)
4月19日	3ヶ月
5月2日	3ヶ月

今月の国債買入オペ予定 [億円]						
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3日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3	8 12 17	4月8日	2
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3	12 17 24	4月3日	3
5年超10年以下	4,000~5,500	4,750	8	12 17 24	4月8日	3
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3	17 24	4月3日	2
25年超	500~1,000	750	8	24	4月8日	1
物価連動債	600	600	月1回		3月28日	1
変動利付債	-	300	-		2023/4/14	-

1年前の市場推移 ○2023年3月積み期 [3月16日~4月14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