



短期市場の推移 [億円] [%]

	3月27日	3月28日	3月31日	4月1日
加重平均金利	0.476	0.477	0.476	0.477
東京レポレート(TN)	0.447	0.301	0.452	0.481
無コール残	81,560	81,733	74,938	84,440
ON	37,179	38,072	37,837	42,644
その他	44,381	43,661	37,101	41,796
有コール残	34,499	37,173	32,450	33,192

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	0.450	0.478	0.477	0.495
T/N	-	-	-	0.484
S/N	-	-	-	-
1W	0.478	0.484	0.480	0.449
2W	-	-	0.550	0.449
3W	-	-	-	0.447
1M	0.540	0.600	0.567	0.449
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.620	0.466
6M	-	-	-	0.509
1Y	-	-	-	0.604

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3日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	日銀当座預金増減要因 (4月見込み)		(米) サービス業PMI (3月)
	-		(米) ISM非製造業指数 (3月)	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月2日	4月3日	4月3日	4月4日	4月4日	4月4日
券	+600		+700		+0	
財政	▲600		+1,100		▲26,000	
過不足	+0		+1,800		▲26,000	
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
国債買入				+7,000		
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
国債補充供給	+4,800	▲3,400	+3,400			
当座預金増減	+1,400		+12,200		▲26,000	
当座預金残高	5,287,200		5,299,400		5,273,400	
準備預金残高	4,782,100		主な需給要因			
積み終了先	4,781,300		国債発行(10年)			
超過準備	4,781,300					
非準備先残高	505,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	58.1%					
乖離率	41.8%					

4月2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(4/3~)						
~1年	1,000	4,703	1,000	0.018	0.019	64.7
1~3年	2,750	9,129	2,752	▲0.006	▲0.005	45.2
3~5年	2,750	8,114	2,760	▲0.010	▲0.009	73.1
25年~	750	2,312	751	▲0.028	▲0.023	61.2
国債補充供給(4/2~4/3)						
	3,476	3,476	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

4月1日時点 6,518,300

所要

今積期の所要準備額	4月3日以降の残り所要	積数	平均
4,121,700		1,100	100

国庫短期証券入札予定

4月4日	3ヶ月(第1297回)
4月9日	6ヶ月(第1298回)
4月11日	3ヶ月
4月17日	1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	1000	1,000	2				4月2日	0
1年超3年以下	2750	2,750	2	9	16	21	4月2日	3
3年超5年以下	2750	2,750	2	16	21	25	4月2日	3
5年超10年以下	3000	3,250	9	16	21	25	3月28日	4
10年超25年以下	1350	1,500	9	21	25		3月28日	3
25年超	750	750	2	16			4月2日	1
物価連動債	500	500	25				3月28日	1
変動利付債	-	300					4月14日	-

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