



短期市場の推移

[億円] [%]

	4月3日	4月4日	4月7日	4月8日
加重平均金利	0.476	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.485	0.495	0.492	0.489
無コール残	85,258	85,623	87,368	87,113
ON	39,057	38,012	37,827	37,327
その他	46,201	47,611	49,541	49,786
有コール残	33,267	32,376	32,782	32,462

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.450	0.478	0.476	0.489
T/N	-	-	-	0.468
S/N	-	-	-	-
1W	0.477	0.650	0.498	0.452
2W	-	-	0.478	0.450
3W	-	-	-	0.449
1M	-	-	-	0.444
2M	-	-	-	-
3M	0.590	0.750	0.643	0.457
6M	-	-	-	0.494
1Y	-	-	-	0.579

無担保コール(速報)は日銀、東京レボ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9日	4月10日	4月10日	4月11日	4月11日	4月11日
券		+500		+200		+0
財政		▲13,100		+7,900		▲20,000
過不足		▲12,600		+8,100		▲20,000
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				+6,600		
CP等買入	▲300		▲100			
国債補完供給	+3,900	▲3,300	+3,300			
当座預金増減		▲12,300		+17,900		▲20,000
当座預金残高		5,263,300		5,281,200		5,261,200
準備預金残高		4,739,000				
積み終了先		4,739,000				
超過準備		4,739,000				
非準備先残高		524,300				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		80.6%				
乖離率		19.4%				

4月9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(4/10~)

1~3年	2,750	12,924	2,754	▲0.021	▲0.018	2.5
5~10年	3,000	6,296	3,003	0.022	0.025	74.0
10~25年	1,350	5,005	1,350	0.225	0.234	6.0

国債補完供給(4/9~4/10)

	3,251	3,251	0.250	0.250
	184	184	0.250	0.250

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▲0.001%の0.476%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。

国庫短期証券入札予定

4月11日	3ヶ月(第1299回)
4月17日	1年
4月18日	3ヶ月
4月25日	3ヶ月

国債入札予定

4月10日	5年
4月15日	20年
4月24日	2年
5月8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	1000	1,000	2		4月2日
1年超3年以下	2750	2,750	2	9 16 21	4月9日
3年超5年以下	2750	2,750	2	16 21 25	4月2日
5年超10年以下	3000	3,000	9	16 21 25	4月9日
10年超25年以下	1350	1,350	9	21 25	4月9日
25年超	750	750	2	16	4月2日
物価連動債	500	500	25		3月28日
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