



短期市場の推移

	4月8日	4月11日	4月12日	4月13日
加重平均金利	▲0.006	▲0.008	▲0.008	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.116	▲0.200	▲0.202	▲0.185
無コール残	191,111	163,492	165,503	164,313
ON	103,873	76,764	84,740	85,080
その他	87,238	86,728	80,763	79,233
有コール残	32,246	26,216	25,382	24,725

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	0.001	▲0.013	▲0.148
T/N	-	-	-	▲0.145
S/N	-	-	▲0.003	-
1W	▲0.020	0.005	▲0.010	▲0.125
2W	▲0.035	▲0.025	▲0.028	▲0.120
3W	-	-	▲0.005	▲0.122
1M	▲0.020	0.011	▲0.003	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	0.000	0.020	0.006	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.114

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		21:30	(米)4月ニューヨーク連銀 製造業景気指数	2.0
	-			-	
	-			-	

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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で取引された。積み終盤のため調達を抑制する動き散見され同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.018	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.005

登営業日のマーケット

積み期最終日のため調達を控える先もあり、出合いの水準は本日対比でやや低下すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月14日		4月15日		4月18日	
券	▲1,300		▲400		▲1,000	
財政	+14,800		+58,900		▲5,000	
過不足	+13,500		+58,500		▲6,000	
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	+10,300					
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲200					
E T F 買入			+500			
国債補充供給	+300	▲1,200	+1,200			
当座預金増減	+22,600		+60,100		▲6,000	
当座預金残高	5,601,800		5,661,900		5,655,900	
準備預金残高	4,930,400		主な需給要因			
積み終了先	4,930,400		国債発行(20Y)		国庫短期証券発行・	
超過準備	4,930,400		年金定時払い		償還(3M)	
非準備先残高	671,400					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.8%					
乖離率	3.2%					

4月14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
国債補充供給(4/14~4/15)	895	895	▲0.450	▲0.450		
	300	300	▲0.450	▲0.450		

マネタリーベース [億円]
4月13日時点 6,824,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,789,900
4月15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15日	3ヶ月(第1073回)
4月19日	1年(第1074回)
4月21日	6ヶ月(第1075回)
4月22日	3ヶ月

国債入札予定

4月27日	2年
5月10日	10年
5月12日	30年
5月16日	物価連動

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4日	0
1年超3年以下	4750	4,750	4 8 13 20	4月13日	1
3年超5年以下	4750	4,750	4 8 20 26	4月8日	2
5年超10年以下	5000	5,000	8 13 20 26	4月13日	2
10年超25年以下	1250	1,250	4 20	4月4日	1
25年超	500	500	13 26	4月13日	1
物価連動債	600	600	月1回	3月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	0

1年前の市場推移

○2021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