



短期市場の推移 [億円] [%]

	3月28日	3月29日	3月30日	3月31日
加重平均金利	▲0.015	▲0.015	▲0.014	▲0.030
東京レポレート(TN)	▲0.251	▲0.331	▲1.205	▲0.118
無コール残	166,981	164,754	169,903	117,777
ON	93,938	93,013	97,567	69,771
その他	73,043	71,741	72,336	48,006
有コール残	27,980	26,868	26,849	20,805

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。

4月4日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
3月調査の日銀短観 (調査全容)				
	-		-	
	-		-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.009	▲0.130
T/N	-	-	▲0.001	▲0.137
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.023	0.001	▲0.010	▲0.141
2W	▲0.020	▲0.003	▲0.011	▲0.146
3W	-	-	0.035	▲0.152
1M	▲0.010	0.000	▲0.007	▲0.167
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲0.174
6M	-	-	-	▲0.128
1Y	-	-	-	▲0.098

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の出会いから始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.003%の水準で取引された。年度末に調達を控えていた先を中心に調達意欲が強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.021%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.005	- ~ -	▲0.010 ~ ▲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く、出会い水準は横ばい圏から若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月3日	4月4日	4月3日	4月4日	4月5日	4月6日
券		+600		+800		+0
財政		▲30,400		▲14,100		▲27,000
過不足		▲29,800		▲13,300		▲27,000
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
共通担保(全店)					▲8,500	
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+51,900	▲51,300	+53,100			
当座預金増減		▲29,300		+39,800		▲35,500
当座預金残高		5,461,500		5,501,300		5,465,800
準備預金残高		4,758,600	主な需給要因			
積み終了先		4,758,500	法人税、消費税、保			
超過準備		4,758,500	険揚げ、			
非準備先残高		702,900	普通交付税			
準備預金進捗率		99.9%				
平均		61.3%				
乖離率		38.6%				

4月3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(固定利回り方式)(4/4~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

米ドル資金供給(4/5~4/12)

0 0 5.070 5.070

国債補完供給(4/3~4/4)

2,120 2,120 ▲1.100 ▲1.560

49,067 49,067 ▲0.350 ▲0.352

0 0

マネタリーベース [億円]

3月31日時点 6,758,500

所要

今積期の所要準備額 3,909,200

4月4日以降の残り所要

積数 700

平均 100

国庫短期証券入札予定

4月6日	6ヶ月(第1149回)
4月7日	3ヶ月(第1150回)
4月14日	3ヶ月
4月19日	1年

国債入札予定

4月4日	10年
4月6日	30年
4月11日	5年
4月20日	20年

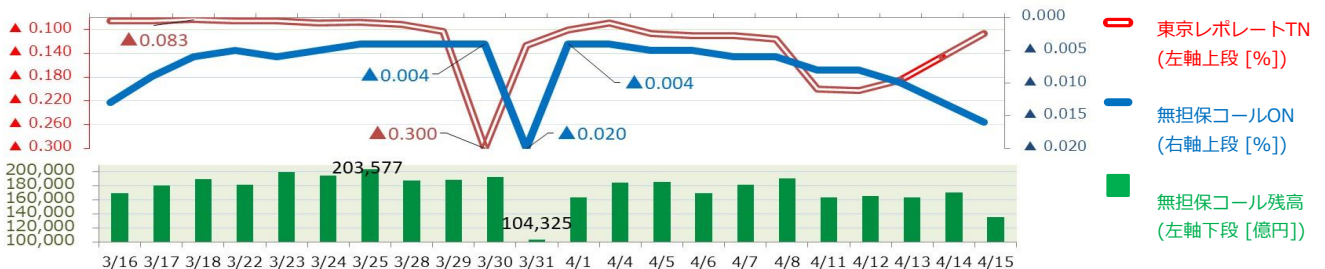
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	3月3日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 21	3月20日	4
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	5 14 21 27	3月29日	4
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	10 14 21 27	3月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	5 10 21 27	3月29日	4
25年超	500~3,500	1,000	10 14 24	3月20日	3
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