



短期市場の推移

	3月29日	3月30日	3月31日	4月3日
加重平均金利	▲0.015	▲0.014	▲0.030	▲0.009
東京レボレート(TN)	▲0.331	▲1.205	▲0.118	▲0.137
無コール残	164,754	169,903	117,777	156,211
ON	93,013	97,567	69,771	91,410
その他	71,741	72,336	48,006	64,801
有コール残	26,868	26,849	20,805	28,842

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。

4月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)3月ISM非製造業景況指数	54.6
-	-	21:30 (米)2月貿易収支	-685億米ドル
-	-	-	-

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.055	0.001	▲0.008	▲0.099
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.040	▲0.005	▲0.037	▲0.138
2W	▲0.025	▲0.015	▲0.021	▲0.142
3W	-	-	-	▲0.148
1M	0.001	0.230	0.083	▲0.163
2M	-	-	-	-
3M	0.150	0.180	0.155	▲0.170
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.098

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.008%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。動向に主だった変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.008%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依然として底堅く推移しており、出会い水準は横ばい圏での出合を予想。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	4月4日		4月5日		4月6日
券	+800		+400		+1,000
財政	▲8,500		▲25,500		+0
過不足	▲7,700		▲25,100		+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲8,500		+8,300
CP等買入			▲100		
国債補完供給	+50,500	▲42,000	+42,700		
当座預金増減	+800		+17,300		+1,000
当座預金残高	5,462,300		5,479,600		5,480,600
準備預金残高	4,760,800		主な需給要因		
積み終了先	4,760,700		国債発行(10年)		
超過準備	4,760,700				
非準備先残高	701,500				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	64.5%				
乖離率	35.4%				

4月4日のオペ結果

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)(4/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(4/6~4/13)						
	0	0	5,070	5,070		
国債補完供給(4/4~4/5)						
	1,378	1,378	▲1,100	▲1,773		
	40,586	40,586	▲0.350	▲0.352		
	0	0				
共通担保(全店)(4/5~4/19)						
	8255	8255				

マネタリーベース (億円)
4月3日時点 6,728,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,909,200
4月5日以降の残り所要	
積数	600
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
4月6日	30年
4月11日	5年
4月20日	20年
4月26日	2年

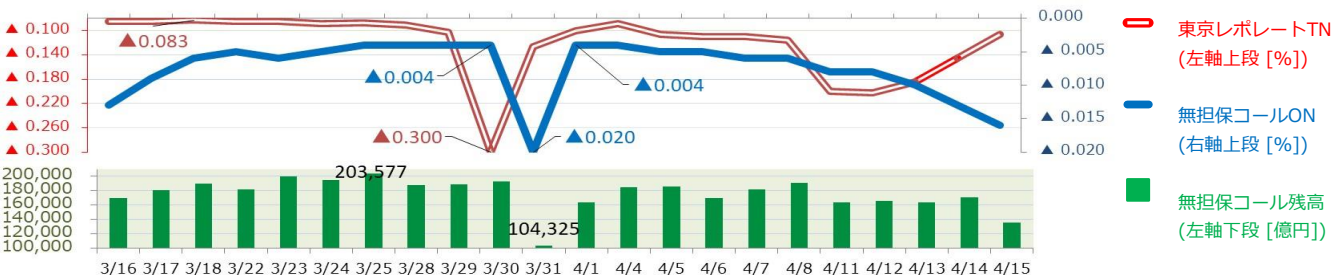
今月の国債買入オペ予定

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