



### 短期市場の推移

	3月30日	3月31日	4月3日	4月4日
加重平均金利	▲0.014	▲0.030	▲0.009	▲0.008
東京レポレート(TN)	▲1.205	▲0.118	▲0.137	▲0.107
無コール残	169,903	117,777	156,211	156,181
ON	97,567	69,771	91,410	86,620
その他	72,336	48,006	64,801	69,561
有コール残	26,849	20,805	28,842	30,924

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	▲0.055	0.001	▲0.007	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.111
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.007	0.000	▲0.004	▲0.137
2W	-	-	-	▲0.142
3W	-	-	-	▲0.150
1M	-	-	-	▲0.166
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.169
6M	-	-	-	▲0.127
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

### 4月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.008%の出会いから始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.001%の水準で取引された。オファービッドともに大きな動向変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.007%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.007 ~ ▲0.004	▲0.008 ~ ▲0.008	▲0.007 ~ ▲0.001

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は引き続き強く、出会い水準は横ばい圏と予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月5日	4月6日	4月5日	4月6日	4月5日	4月6日
券	+400		▲200		▲1,000	
財政	▲24,700		▲2,000		▲9,000	
過不足	▲24,300		▲2,200		▲10,000	
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入				+13,200		
共通担保(全店)	▲8,500	+8,300				
CP等買入	▲100					
国債補充供給	+42,000	▲34,400	+35,000			
当座預金増減	▲17,000		+47,000		▲10,000	
当座預金残高	5,445,300		5,492,300		5,482,300	
準備預金残高	4,751,600					
積み終了先	4,751,500					主な需給要因
超過準備	4,751,500					国債発行(30年)
非準備先残高	693,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

### 4月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(4/6~)	1,000	4,954	1,000	0.023	0.023	40.0
国債買入(固定利回り方式)(4/6~)						
5~10年	0	0				
国債買入(4/6~)						
~1年	1,500	5,198	1,501	▲0.005	▲0.002	85.5
1~3年	4,250	8,882	4,257	▲0.005	▲0.003	34.6
3~5年	5,000	10,733	5,004	0.002	0.003	95.7
10~25年	2,500	5,290	2,509	0.002	0.006	37.2
米ドル資金供給(4/7~4/14)	0	0	5,070	5.070		

マネタリーベース (億円)  
4月4日時点 6,728,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,909,200
4月6日以降の残り所要	
積数	500
平均	0

### 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

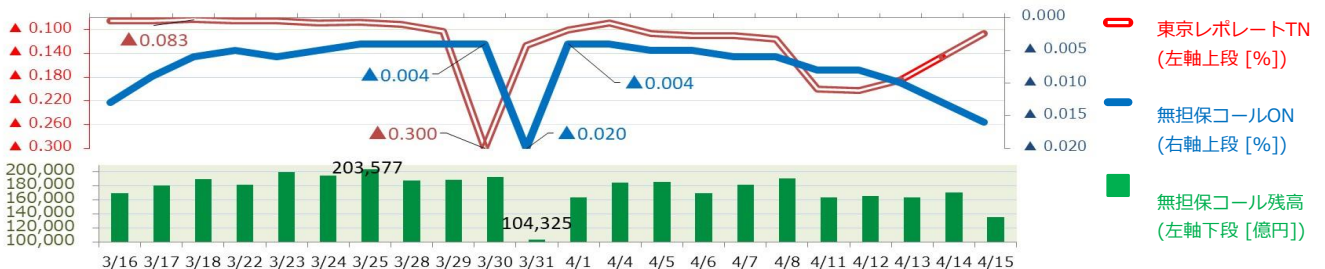
### 今月の国債買入オペ予定

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5日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 21	4月5日	3
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	5 14 21 27	4月5日	3
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	2,500	5 10 21 27	4月5日	3
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