



短期市場の推移

	4月3日	4月4日	4月5日	4月6日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.007	▲0.006
東京レボレート(TN)	▲0.137	▲0.107	▲0.111	▲0.131
無コール残	156,211	156,181	160,546	168,640
ON	91,410	86,620	90,360	95,604
その他	64,801	69,561	70,186	73,036
有コール残	28,842	30,924	30,460	29,506

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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.005	▲0.113
T/N	-	-	-	▲0.144
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.015	▲0.009	▲0.010	▲0.161
2W	▲0.040	0.031	▲0.026	▲0.165
3W	-	-	-	▲0.173
1M	-	-	▲0.001	▲0.178
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.177
6M	-	-	-	▲0.132
1Y	-	-	-	▲0.099

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.003%の割合から始まり、その後は主に▲0.006%～▲0.001%の水準で取引された。週末3日積み要因もあり、一部ビッドサイドの調達意欲が強まりON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.005%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.004 ~ ▲0.003	▲0.003 ~ ▲0.003	▲0.006 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因の剥落から、出合水準は若干の低下を予想する。

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7日	4月10日	4月10日	4月11日	4月11日	4月11日
券		+1,200		+700		+0
財政		▲7,600		▲7,000		+1,000
過不足		▲6,400		▲6,300		+1,000
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
CP等買入	▲200		▲100			
E T F 買入				+700		
国債補完供給	+36,500	▲35,300	+36,000			
当座預金増減		▲5,400	+30,300			+1,000
当座預金残高		5,454,700	5,485,000			5,486,000
準備預金残高		4,755,000				主な需給要因
積み終了先		4,754,900	国庫短期証券発行・償還(3M・6M)			
超過準備		4,754,900				
非準備先残高		699,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		80.6%				
乖離率		19.3%				

4月7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)(4/10~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(4/11~4/18)						
	0	0	5,070	5,070		
国債補完供給(4/7~4/10)						
	837	837	▲1,100	▲1,631		
	34,547	34,547	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナタリーベース (億円)
4月6日時点 6,726,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,918,900
4月10日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

4月14日	3ヶ月(第1151回)
4月19日	1年
4月21日	3ヶ月
5月2日	3ヶ月

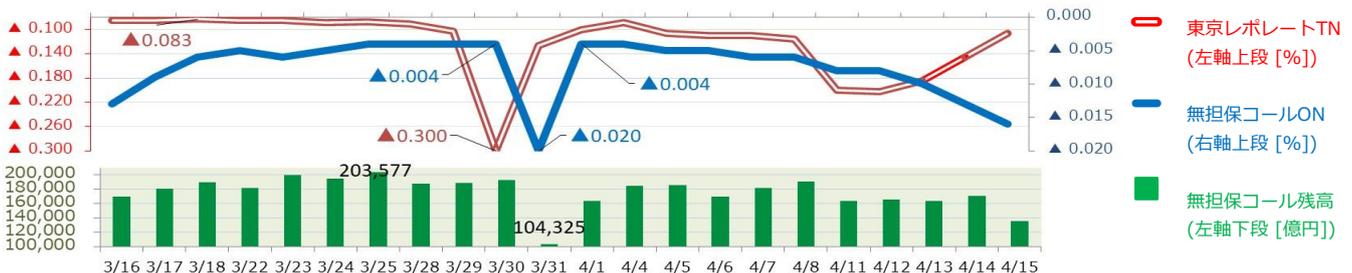
今月の国債買入オペ予定

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