



短期市場の推移

	3月26日	3月27日	3月28日	3月29日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.074
東京レポレート(TN)	0.025	0.010	0.005	0.010
無コール残	91,145	86,911	85,509	94,421
ON	50,372	46,548	46,706	64,568
その他	40,773	40,363	38,803	29,853
有コール残	33,809	33,630	34,401	27,244

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	0.078	0.077	0.013
T/N	-	-	-	0.010
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.150	0.016
2W	0.160	0.195	0.190	0.023
3W	-	-	-	0.030
1M	0.135	0.200	0.171	0.038
2M	-	-	-	-
3M	0.170	0.220	0.182	0.051
6M	-	-	-	0.074
1Y	-	-	-	0.103

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2日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	3月調査の日銀短観 (調査全容)		(欧) ユーロ圏製造業PMI (3月/確報)	
8:50	3月のマネタリーベース		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.077%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.077%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.077

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月1日	4月2日	4月1日	4月2日	4月3日	4月3日
債券	+700	+100	+700	+100	+0	+0
財政	▲14,700	▲6,700	▲14,700	▲6,700	▲34,000	▲34,000
過不足	▲14,000	▲6,600	▲14,000	▲6,600	▲34,000	▲34,000
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)					▲23,500	
国債補充供給	+42,600	▲44,400	+44,400			
当座預金増減	▲15,800	+37,800	▲15,800	+37,800	▲57,500	▲57,500
当座預金残高	5,596,100	5,633,900	5,596,100	5,633,900	5,576,400	5,576,400
準備預金残高	4,910,300		4,910,300			
積み終了先	4,910,300		4,910,300			
超過準備	4,910,300		4,910,300			
非準備先残高	685,800		685,800			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	54.8%		54.8%			
乖離率	45.1%		45.1%			

4月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(4/1~4/2)	44,903	44,903	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース	3月29日時点	所要
	6,867,900	

今積期の所要準備額	4,047,500
4月2日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国債短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月(第1222回)
4月5日	3ヶ月(第1223回)
4月9日	6ヶ月
4月12日	3ヶ月

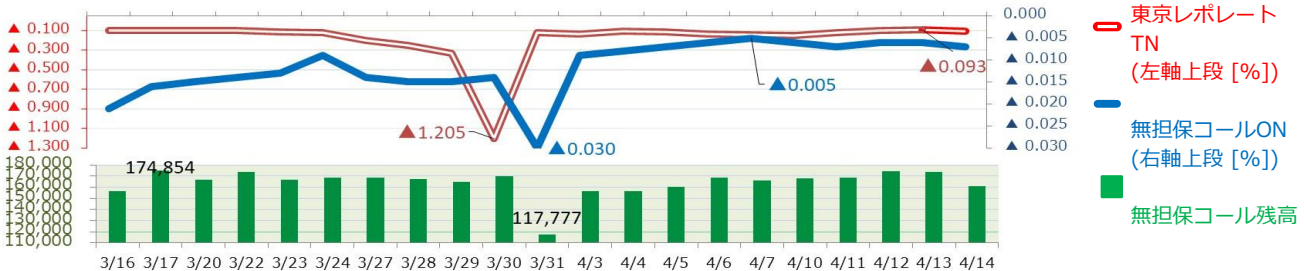
今月の国債買入オペ予定

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	3月4日	1
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3 8 12 17	3月22日	4
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3 12 17 24	3月28日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,750	8 12 17 24	3月28日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3 17 24	3月28日	3
25年超	500~1,000	750	8 24	3月15日	2
物価連動債	600	600	月1回	3月28日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2023年3月積み期 [3月16日~4月14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