



短期市場の推移

	3月28日	3月29日	4月1日	4月2日
加重平均金利	0.077	0.074	0.077	0.077
東京レボレート(TN)	0.005	0.010	0.010	0.009
無コール残	85,509	94,421	84,914	79,915
ON	46,706	64,568	51,621	44,647
その他	38,803	29,853	33,293	35,268
有コール残	34,401	27,244	30,013	31,255

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。
 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	0.060	0.130	0.077	0.019
T/N	-	-	-	0.014
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.020
2W	-	-	0.150	0.025
3W	-	-	-	0.027
1M	0.137	0.150	0.141	0.031
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.200	0.051
6M	-	-	-	0.074
1Y	-	-	-	0.104

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

4月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
地域経済報告(さくらレポート)		(米) 貿易収支(2月)	
-		-	
-		-	

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%~0.078%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

ビット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3日		4月4日		4月5日	
券	+200		+300		+0	
財政	▲15,900		▲2,000		▲8,000	
過不足	▲15,700		▲1,700		▲8,000	
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
国債買入				+10,900		
共通担保(全店)	▲23,500	+8,000				
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+42,900	+38,100	+38,100			
当座預金増減	▲26,500		+47,300		▲8,000	
当座預金残高	5,555,900		5,603,200		5,595,200	
準備預金残高	4,880,300		主な需給要因			
積み終了先	4,880,300		国庫短期証券発行償還		国債発行(30年)	
超過準備	4,880,300		(3M)			
非準備先残高	675,600					
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(4/4~)						
~1年	1,500	2,296	1,501	▲0.005	0.012	89.0
1~3年	3,750	7,887	3,754	▲0.006	▲0.004	92.8
3~5年	4,250	8,789	4,257	▲0.007	▲0.005	94.9
10~25年	1,500	3,405	1,504	0.006	0.008	45.0
国債補完供給(4/3~4/4)						
	38,576	38,576	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
4月2日時点 6,837,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,047,500
4月4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5日	3ヶ月(第1223回)
4月9日	6ヶ月(第1224回)
4月12日	3ヶ月
4月18日	1年
国債入札予定	
4月4日	30年
4月9日	5年
4月11日	20年
4月23日	2年

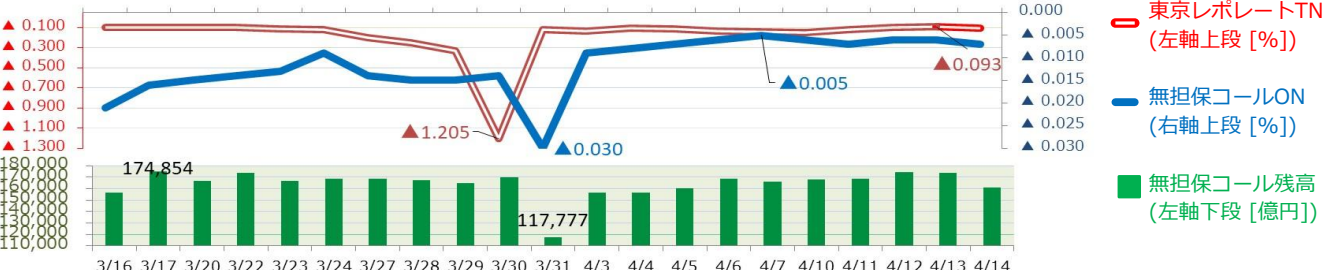
今月の国債買入オペ予定

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	4月3日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3 8 12 17	4月3日	3
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3 12 17 24	4月3日	3
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	4月3日	2
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