



短期市場の推移

	3月29日	4月1日	4月2日	4月3日
加重平均金利	0.074	0.077	0.077	0.077
東京レボレート(TN)	0.010	0.010	0.009	0.014
無コール残	94,421	84,914	79,915	87,911
ON	64,568	51,621	44,647	51,618
その他	29,853	33,293	35,268	36,293
有コール残	27,244	30,013	31,255	33,059

4月5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	消費活動指数 (2月)		(米) 雇用統計(3月)	
	-		-	
	-		-	

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	0.078	0.077	0.036
T/N	-	-	-	0.045
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.030
2W	-	-	-	0.029
3W	-	-	-	0.031
1M	-	-	-	0.036
2M	-	-	-	-
3M	0.170	0.270	0.189	0.053
6M	-	-	-	0.075
1Y	-	-	-	0.104

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

3日積み要因もあり、ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であると思われるため、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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4日	4月5日	4月5日	4月8日	4月8日
券		+400	+700		+1,000
財政		+3,000	+600		▲7,000
過不足		+3,400	+1,300		▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+10,900			
CP等買入			▲100		
国債補充供給	+38,100	▲38,300	+38,300		
当座預金増減		+14,100	+39,500		▲6,000
当座預金残高		5,570,000	5,609,500		5,603,500
準備預金残高		4,907,400			
積み終了先		4,907,400			
超過準備		4,907,400			
非準備先残高		662,600			
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
国債補充供給(4/4~4/5)						
	38,698	38,698	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース	所要
4月3日時点	6,810,900

所要	所要
今積期の所要準備額	4,047,500
4月5日以降の残り所要	
積数	100
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

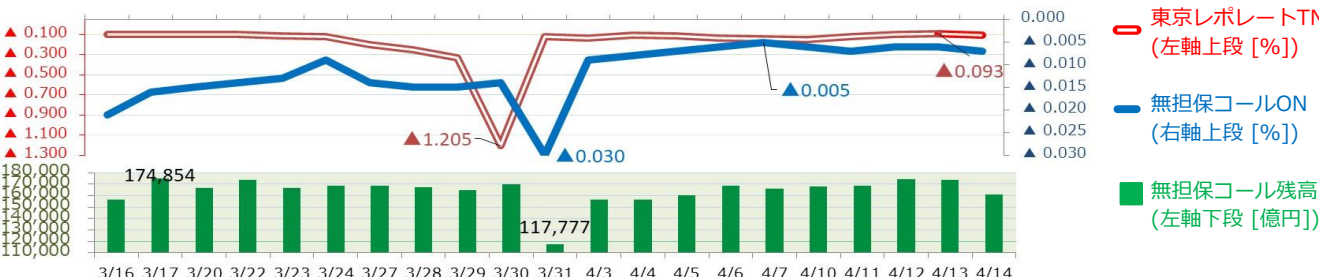
今月の国債買入オペ予定

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。