



短期市場の推移

	4月1日	4月2日	4月3日	4月4日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.010	0.009	0.014	0.045
無コール残	84,914	79,915	87,911	88,933
ON	51,621	44,647	51,618	51,510
その他	33,293	35,268	36,293	37,423
有コール残	30,013	31,255	33,059	35,692

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	0.060	0.078	0.077	0.048
T/N	-	-	-	0.054
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.039
2W	-	-	-	0.037
3W	-	-	-	0.037
1M	-	-	0.150	0.036
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.190	0.053
6M	-	-	-	0.075
1Y	-	-	-	0.104

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8日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	国際収支(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0.076%~0.078%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は底堅く、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
- ~ -	- ~ -	0.076 ~ 0.078

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5日		4月8日		4月9日	
券	+800		+900		+1,000	
財政	+5,400		▲5,300		▲3,000	
過不足	+6,200		▲4,400		▲2,000	
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	▲100		▲500			
国債補充供給	+38,300	▲36,400	+36,400			
当座預金増減	+8,000		+31,500		▲2,000	
当座預金残高	5,578,000		5,609,500		5,607,500	
準備預金残高	4,917,800		主な需給要因			
積み終了先	4,917,700		国庫短期証券発行償還(3M)			
超過準備	4,917,700					
非準備先残高	660,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

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
国債補充供給(4/5~4/8)	36,829	36,829	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース	4月4日時点
6,824,600	

所要	今積期の所要準備額	4月8日以降の残り所要	積数	平均
	4,056,600		100	0

国庫短期証券入札予定

4月9日	6ヶ月(第1224回)
4月12日	3ヶ月(第1225回)
4月18日	1年
4月19日	3ヶ月

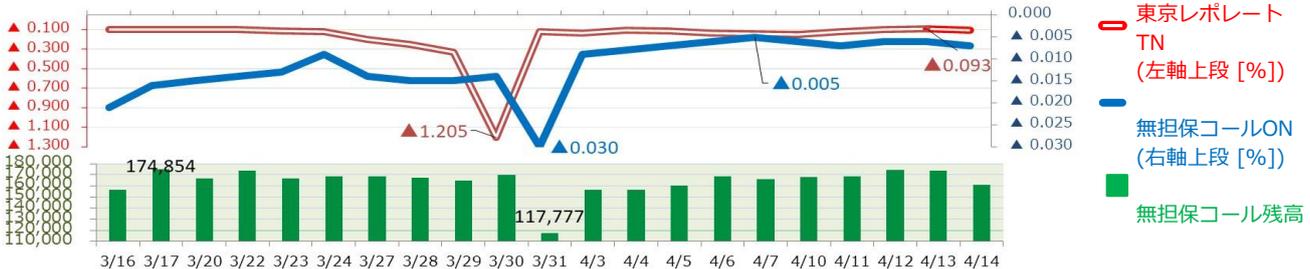
今月の国債買入オペ予定

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