

2020年4月10日(金)

短期市場の推移

	4月6日	4月7日	4月8日	4月9日
加重平均金利	▲0.022	▲0.035	▲0.046	▲0.048
東京レポレート(ON)	▲0.122	▲0.146	▲0.233	▲0.205
無コール残	101,150	103,852	101,522	102,607
ON	70,007	71,669	68,959	69,324
その他	31,143	32,183	32,563	33,283
有コール残	7,167	10,586	7,163	7,462

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。

4月13日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(3月)	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	0.001	▲0.032	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.000	▲0.005	▲0.124
2W	-	-	▲0.020	▲0.139
3W	-	-	-	▲0.158
1M	▲0.007	▲0.001	▲0.004	▲0.164
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.171
6M	-	-	-	▲0.209
1Y	-	-	-	▲0.219

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.03%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.010%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.016%の▲0.032%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	▲0.060 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.030	▲0.060 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

積み終盤となることから、出合の水準は本日よりも上昇する見込み。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月10日	4月13日	4月14日
券	▲300	+700	+0
財政	▲18,400	▲6,700	▲9,000
過不足	▲18,700	▲6,000	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲100	▲14,300	+14,600
CP等買入	-	▲100	-
社債等買入	-	▲100	+1,500
ETF買入	-	-	+900
国債補完供給	+2,300	+300	-
米ドル資金供給用担保国債供給	+11,100	+400	+400
新型コロナ企業金融支援特別	-	+5,600	-
当座預金増減	▲2,600	+2,800	▲8,600
当座預金残高	3,969,200	3,972,000	3,963,400
準備預金残高	3,421,400	-	-
積み終了先	3,421,300	-	-
超過準備	3,421,300	-	-
非準備先残高	547,800	-	-
準備預金進捗率	99.9%	-	-
平均	90.3%	-	-
乖離率	9.6%	-	-

4月10日のオペ結果 [元][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
------	------	----	----	----	----	----

米ドル資金供給(4/14~4/21)
600 600 0.300 0.300

国債補完供給(4/10~4/13)	222	▲0.350	▲0.350
	46	▲0.350	▲0.350

共通担保(全店)(4/13~4/27)

20,000 14,570 14,570

新型コロナ企業金融支援特別(4/13~1/13)

5,628 5,628

マネタリーベース[億円] 所要[億円]
4月9日時点 5,120,100 今積期の所要準備額 3,255,300

4月13日以降の残り所要	積数	600
	平均	200

国庫短期証券入札予定

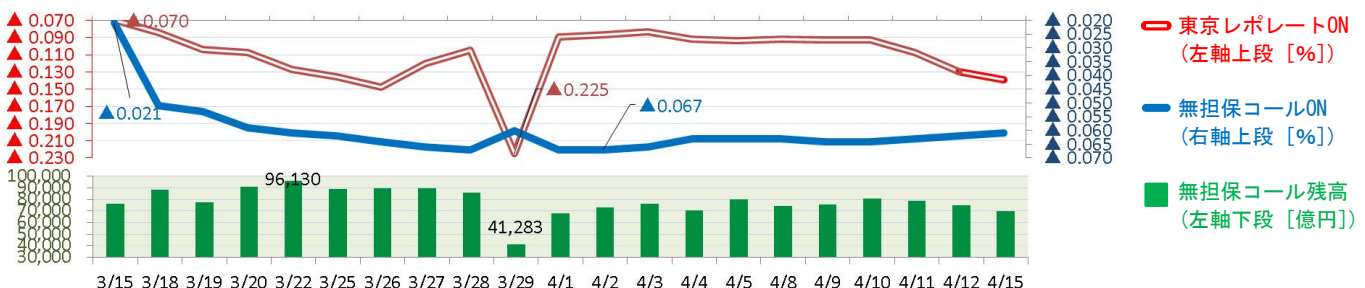
4月16日	1年	第901回
4月17日	3ヶ月	第902回
4月24日	3ヶ月	-
5月1日	3ヶ月	-
国債入札予定	-	-
4月21日	20年	-
4月23日	2年	-
5月8日	物価運動	-
5月12日	10年	-

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	500~1,000 程度	800	月3回程度	4月6日	2
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	3,200	3 8 13 15 17 27	4月8日	4
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	1 3 13 17 22 27	4月3日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 27	4月8日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	3 24	4月3日	1
25年超	0~500 程度	300	3 24	4月3日	1
物価運動債	300 程度	300	月2回程度	4月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月6日	0

1年前の市場推移 ○2019年3月積み期 [3月15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。