

短期市場の推移

	4月7日	4月8日	4月9日	4月10日
加重平均金利	▲0.035	▲0.046	▲0.048	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.146	▲0.233	▲0.205	▲0.094
無コール残	103,852	101,522	102,607	105,994
ON	71,669	68,959	69,324	71,861
その他	32,183	32,563	33,283	34,133
有コール残	10,586	7,163	7,462	18,365

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14日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (4月10日現在)	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.050	0.001	▲0.019	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.112
2W	-	-	0.001	▲0.121
3W	-	-	-	▲0.146
1M	-	-	-	▲0.152
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.158
6M	-	-	-	▲0.205
1Y	-	-	-	▲0.216

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲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+0.013%の▲0.019%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025		▲0.020 ~ ▲0.005	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向は変わらず、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 4月13日	日銀予想 4月14日	当社需給予想 4月15日
券	+300	▲400	+0
財政	▲5,900	▲4,700	+78,000
過不足	▲5,600	▲5,100	+78,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+9,800
共通担保(全店)	▲14,300	+14,600	
CP等買入	▲100	▲200	
社債等買入	▲100	+1,500	
ETF買入		+900	+800
国債補完供給	+300	▲1,100	+1,100
米ドル資金供給用担保国債供給	+400	+400	+6,100
新型コロナ企業金融支援特別		+5,600	
当座預金増減	+2,100	+6,800	+84,100
当座預金残高	3,971,300	3,978,100	4,062,200
準備預金残高	3,443,600	主な需給要因	
積み終了先	3,443,500	源泉税揚げ	
超過準備	3,443,500	国債発行(個人)	
非準備預金残高	527,700	国債償還(2年・個人)	
準備預金進捗率	99.9%	年金定時払い	
平均	93.5%		
乖離率	6.4%		

4月13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	接分
国債買入(4/14~)						
1~3年	3,200	8,434	3,201	▲0.009	▲0.007	26.7
3~5年	2,800	7,008	2,804	▲0.007	▲0.005	86.4
5~10年	3,500	9,777	3,506	▲0.006	▲0.004	26.9
米ドル資金供給(4/15~4/22)						
		931	931	0.300	0.300	
国債補完供給(4/13~4/14)						
	995	995	▲0.350	▲0.350		
	46	46	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
4月10日時点 5,117,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,255,300
4月14日以降の残り所要積数 400
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	
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13日	3
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	1 3 13 17 22 27	4月13日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 27	4月13日	2
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。