

2020年4月14日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	4月8日	4月9日	4月10日	4月13日
加重平均金利	▲0.046	▲0.048	▲0.032	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.233	▲0.205	▲0.094	▲0.085
無コール残	101,522	102,607	105,994	99,367
ON	68,959	69,324	71,861	64,884
その他	32,563	33,283	34,133	34,483
有コール残	7,163	7,462	18,365	17,785

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		21:30	(米)3月小売売上高 -6.4%
-		23:00	(加)4月カナダ中銀政策金利 0.25%
-			(米)ベージュブック

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	▲0.010	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.104
2W	0.000	0.001	0.001	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.128
1M	-	-	▲0.015	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.197
1Y	-	-	-	▲0.208

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▲0.015%~▲0.005%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+0.009%の▲0.01%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.010 ~ ▲0.005	▲0.015 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、横ばい圏での出合を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月14日	4月15日	4月16日
券	▲500	▲500	▲1,000
財政	▲1,500	+82,400	+8,000
過不足	▲2,000	+81,900	+7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+2,500
国債買入	+9,800	▲300	
CP等買入	▲200		
ETF買入	+800	+900	
国債補完供給	+1,100	+600	
米ドル資金供給用担保国債供給	+400	+6,300	▲20,000
当座預金増減	+9,300	+71,900	+21,800
当座預金残高	3,980,600	4,052,500	4,074,300
準備預金残高	3,452,800		
積み終了先	3,452,600		
超過準備	3,452,600		
非準備先残高	527,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	96.8%		
乖離率	3.1%		

4月14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
国庫短期証券買入(4/15~)	2,500	8,149	2,500	0.002	0.010	14.5
米ドル資金供給(4/16~4/23)			2,210	0.310	0.310	
米ドル資金供給(4/16~7/9)			26,958	0.330	0.330	
CP等買入(4/17~)	5,500	17,240	5,500	0.106	0.164	47.1
国債補完供給(4/14~4/15)			532	▲0.350	▲0.350	
			33	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(4/15~4/24)	5,000	917	917	▲0.100	▲0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(4/15~7/10)	20,000	18,681	18,681	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース [億円]
4月13日時点 5,119,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,255,300
4月15日以降の残り所要
積数 200
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	

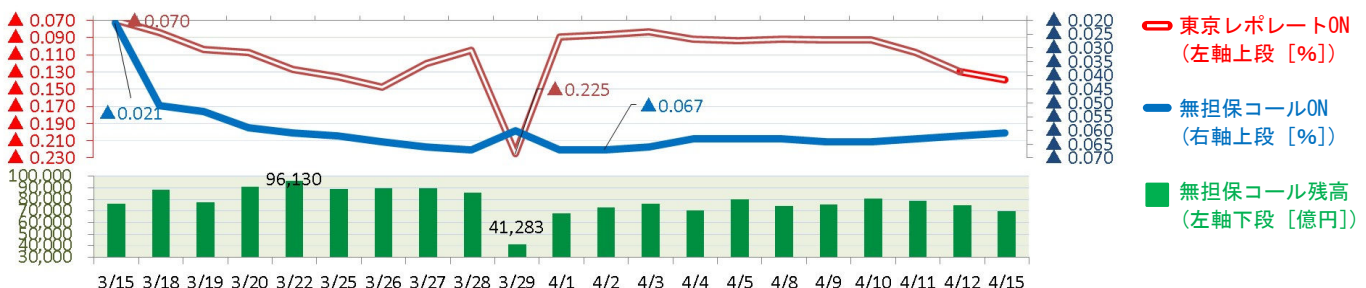
今月の国債買入オペ予定

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。