

短期市場の推移

	4月13日	4月14日	4月15日	4月16日
加重平均金利	▲0.019	▲0.010	▲0.009	▲0.044
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.082	▲0.087	▲0.124
無コール残	99,367	101,892	101,314	103,332
ON	64,884	65,709	65,086	67,539
その他	34,483	36,183	36,228	35,793
有コール残	17,785	18,377	17,957	15,014

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20日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	3月貿易収支	4546億円	17:00	(欧)2月経常収支	-
	-		18:00	(欧)1月貿易収支	-
	-			-	-

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	▲0.087	0.001	▲0.046	▲0.109
T/N	-	-	▲0.001	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.027	▲0.119
2W	-	-	▲0.020	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.133
1M	-	-	▲0.018	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.148
6M	-	-	-	▲0.185
1Y	-	-	-	▲0.201

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.05%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.020%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▲0.002%の▲0.046%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの動向に大きな変化はなく、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月17日	4月20日	4月21日
券	▲1,200	▲1,400	+0
財政	+9,800	+3,300	+9,000
過不足	+8,600	+1,900	+9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+6,100	
CP等買入	▲200	▲300	
社債等買入	▲300	▲200	
ETF買入	+1,600	+700	
被災地金融機関支援	▲1,300		
国債補完供給	+300		
米ドル資金供給用担保国債供給	+11,100		
当座預金増減	+26,600	+8,200	+9,000
当座預金残高	4,102,600	4,110,800	4,119,800
準備預金残高	3,564,000	主な需給要因	
積み終了先	3,557,600	国庫短期証券	
超過準備	3,373,100	発行・償還(3M・1Y)	
非準備預金残高	538,600		
準備預金進捗率	99.2%		
平均	13.3%		
乖離率	85.8%		

4月17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(4/20~)	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
1~3年	3,200	8,860	3,204	0.012	0.013	94.5
3~5年	2,800	7,574	2,808	0.007	0.008	25.2

米ドル資金供給(4/21~4/28)

	640	640	0.300	0.300
--	-----	-----	-------	-------

国債補完供給(4/17~4/20)

	14	14	▲0.350	▲0.350
	0	0		

マナタリーベース [億円] 所要 [億円]
4月16日時点 5,226,700 今積期の所要準備額 3,209,400
4月20日以降の残り所要積数 27,000
平均 1,000

国庫短期証券入札予定

4月24日	3ヶ月	第903回
5月1日	3ヶ月	
5月7日	6ヶ月	
5月8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15日	1
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	3,200	3 8 13 15 17 27	4月17日	1
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	1 3 13 17 22 27	4月17日	2
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4月積み期 [4月16日~5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。 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