

2020年4月21日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	4月15日	4月16日	4月17日	4月20日
加重平均金利	▲0.009	▲0.044	▲0.046	▲0.042
東京レポレート(ON)	▲0.087	▲0.124	▲0.109	▲0.101
無コール残	101,314	103,332	104,283	106,277
ON	65,086	67,539	68,540	70,959
その他	36,228	35,793	35,743	35,318
有コール残	17,957	15,014	13,851	16,756

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22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20日現在)	-	(米)週間のMBA 住宅ローン申請指数	
	-		(米)2月のFHFA 住宅価格指数	
	-			

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	▲0.043	▲0.116
T/N	-	-	-	▲0.149
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.001	▲0.005	▲0.138
2W	-	-	▲0.020	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.143
1M	▲0.030	▲0.026	▲0.028	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.183
1Y	-	-	-	▲0.198

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▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲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▲0.001%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.055 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に変化はなく、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 4月21日	日銀予想 4月22日	当社需給予想 4月23日
券	▲1,500	▲1,500	▲2,000
財政	+2,700	▲8,300	+7,000
過不足	+1,200	▲9,800	+5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	▲100	▲100	+900
CP等買入	▲100	▲100	+900
ETF買入	▲100	▲100	+900
国債補完供給	+900	▲300	+300
米ドル資金供給用担保国債供給			▲21,600
当座預金増減	+1,700	▲25,300	+5,000
当座預金残高	4,114,100	4,088,800	4,093,800
準備預金残高	3,563,200	3,561,300	3,561,300
積み終了先	3,561,300	3,561,300	3,561,300
超過準備	3,560,300	3,560,300	3,560,300
非準備先残高	550,900	550,900	550,900
準備預金進捗率	99.4%	99.4%	99.4%
平均	20.0%	20.0%	20.0%
乖離率	79.4%	79.4%	79.4%

4月21日のオペ結果 [円][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(4/22~)	5,000	9,244	5,002	▲0.013	▲0.004	2.1
米ドル資金供給(4/23~4/30)	1,290	1,290	0.300	0.300		
米ドル資金供給(4/23~7/16)	19,903	19,903	0.320	0.320		
国債補完供給(4/21~4/22)	296	296	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(4/22~7/17)	25,000	21,123	21,123	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース [億円]
4月20日時点 5,265,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,209,400
4月22日以降の残り所要
積数 18,400
平均 800

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	

国債入札予定

4月23日	2年	
5月8日	物価連動	
5月12日	10年	
5月14日	30年	

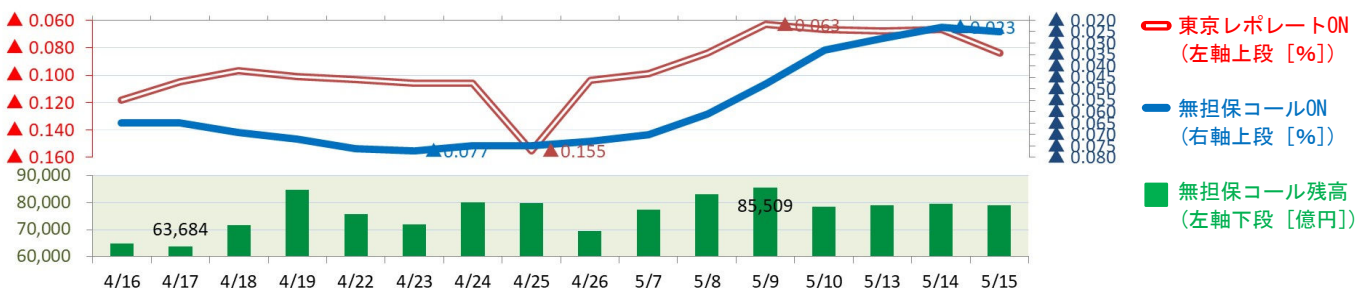
今月の国債買入オペ予定

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
物価連動債	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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会