

平成31年4月15日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

4月16日の予定(時刻は日本時間)

	4月9日	4月10日	4月11日	4月12日
加重平均金利	▲0.064	▲0.064	▲0.063	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.093	▲0.107	▲0.130
無コール残	75,878	80,593	79,058	74,835
ON	46,368	50,718	49,163	44,985
その他	29,510	29,875	29,895	29,850
有コール残	24,263	22,595	22,957	19,158

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。

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	▲0.086	0.001	▲0.061	▲0.139
T/N	-	-	-	▲0.142
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.040	▲0.043	▲0.140
2W	-	-	▲0.030	▲0.151
3W	-	-	▲0.030	▲0.151
1M	-	-	▲0.015	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.145
6M	-	-	-	▲0.155
1Y	-	-	-	▲0.158

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

積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.080%の出合から始まり、その後は主に、▲0.086%~▲0.025%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.061%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085		- ~ -	▲0.086 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月15日	4月16日	4月17日
券	▲1,000	▲1,200	+0
財政	+77,600	+4,400	▲6,000
過不足	+76,600	+3,200	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+10,400		スタート
共通担保(全店)	▲1,800	+1,900	
CP等買入	▲100		
ETF買入	+400		
国債補完供給	+100	▲900	+900
当座預金増減	+86,600	+4,100	▲6,000
当座預金残高	3,969,600	3,973,700	3,967,700
準備預金残高	3,465,500	主な需給要因	
積み終了先	3,465,500		
超過準備	3,465,500		
非準備先残高	504,100		
準備預金進捗率	100.0%	国債発行(20年)	
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

4月15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

国債補完供給(4/15~4/16)					
186,262	792	792	▲0.600	▲0.600	
10,000	85	85	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
4月12日時点 5,008,000	来積期の所要準備額 3,065,000
	4月16日以降の残リ所要
	積数 3,065,000
	平均 102,200

国庫短期証券入札予定

4月18日	1年	第827回
4月19日	3ヶ月	第828回
5月8日	3ヶ月	
5月9日	6ヶ月	

国債入札予定

4月16日	20年
4月23日	2年
5月8日	10年
5月10日	物価連動

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	4月8日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 12 19 24	4月12日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	3 10 17 26	4月10日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	8 12 19 24	4月12日	2
25年超	100~1,000 程度	500			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	4月10日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月10日	0

1年前の市場推移

○2018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