



短期市場の推移

	3月29日	3月30日	3月31日	4月1日
加重平均金利	▲0.014	▲0.014	▲0.044	▲0.014
東京レポレート(TN)	▲0.090	▲0.112	▲0.095	▲0.091
無コール残	138,028	130,110	83,339	129,702
ON	77,360	72,492	55,796	88,919
その他	60,668	57,618	27,543	40,783
有コール残	27,178	21,476	13,751	22,484

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	▲0.080	0.001	▲0.012	▲0.081
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.008	0.000	▲0.007	▲0.084
2W	▲0.015	▲0.002	▲0.008	▲0.087
3W	-	-	0.150	▲0.092
1M	0.001	0.250	0.120	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.117
1Y	-	-	-	▲0.138

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

4月5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	需給ギャップと潜在成長率	-	(米) 3月 サービス業PMI (確報)	-
	-	-	(米) 3月 ISM非製造業指数	-
	-	-	(米) 2月 製造業受注	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.002%の水準で出合が見られた。3日積みということもあり、ビッドサイドの調達ニーズが強く、堅調な地合で推移した。
 なお、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.010	▲0.013 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合水準は本日と横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月2日		4月5日		4月6日	
券	+300		+600		+1,000	
財政	▲33,900		▲8,000		+1,000	
過不足	▲33,600		▲7,400		+2,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債補完供給	+1,100	▲300	+300	-	-	-
当座預金増減	▲32,800		▲7,100		+2,000	
当座預金残高	5,167,000		5,159,900		5,161,900	
準備預金残高	4,555,000		主な需給要因			
積み終了先	4,555,000		国庫短期証券			
超過準備	4,555,000		発行・償還			
非準備先残高	612,000		(3M)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.5%					
乖離率	35.4%					

4月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(4/2~4/5)	308	308	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース	【億円】
4月1日時点	6,411,000

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,631,700
4月5日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

4月8日	6ヶ月	第985回
4月9日	3ヶ月	第986回
4月16日	3ヶ月	
4月19日	1年	

国債入札予定

4月6日	30年
4月8日	5年
4月20日	20年
4月28日	2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	1500	1,000	月1回程度	3月12日	1
1年超3年以下	4750	4,000	5 14 21 26	3月26日	4
3年超5年以下	4500	3,700	5 14 19 26	3月31日	4
5年超10年以下	4500	4,200	7 14 21 26	3月26日	4
10年超25年以下	2000	1,200	7	3月31日	1
25年超	500	300	19	3月31日	1
物価連動債	600	300	月1回程度	3月26日	1
変動利付債<四半期>	300	500	4月21日	2月22日	1

1年前の市場推移

○2020年3月積み期 [3月16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。 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