



短期市場の推移

	3月30日	3月31日	4月1日	4月2日
加重平均金利	▲0.014	▲0.044	▲0.014	▲0.012
東京レポレート(TN)	▲0.112	▲0.095	▲0.091	▲0.079
無コール残	130,110	83,339	129,702	134,690
ON	72,492	55,796	88,919	90,092
その他	57,618	27,543	40,783	44,598
有コール残	21,476	13,751	22,484	22,767

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	▲0.070	0.001	▲0.010	▲0.063
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.078
2W	-	-	0.030	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.085
1M	▲0.004	0.100	0.008	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.136

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.002%の水準で合出が見られた。引き続き都銀・地銀を中心に資金調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.012 ~ ▲0.012	▲0.020 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

堅調な地合は継続するものとみられ、出合水準は本日対比やや上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月5日		4月6日		4月7日	
券	+600		+800		+0	
財政	▲10,700		+1,800		▲9,000	
過不足	▲10,100		+2,600		▲9,000	
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
国債買入				+10,900		
共通担保(全店)					▲4,900	
CP等買入			▲100			
E T F買入				+500		
国債補充供給	+300	▲400	+400			
当座預金増減	▲10,200		+14,300		▲13,900	
当座預金残高	5,156,800		5,171,100		5,157,200	
準備預金残高	4,572,100		主な需給要因			
積み終了先	4,572,100		国債発行(30年)			
超過準備	4,572,000					
非準備先残高	584,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

4月5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

国債買入(4/6~)							
~1年	1,500	3,912	1,503	0.005	0.008	1.1	
1~3年	4,750	11,490	4,755	0.000	0.002	37.2	
3~5年	4,500	14,216	4,504	0.002	0.003	99.2	
国債補充供給(4/5~4/6)							
	424	424	▲0.350	▲0.350			
	0	0					

マネタリーベース [億円]
4月2日時点 6,378,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,631,700
4月6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

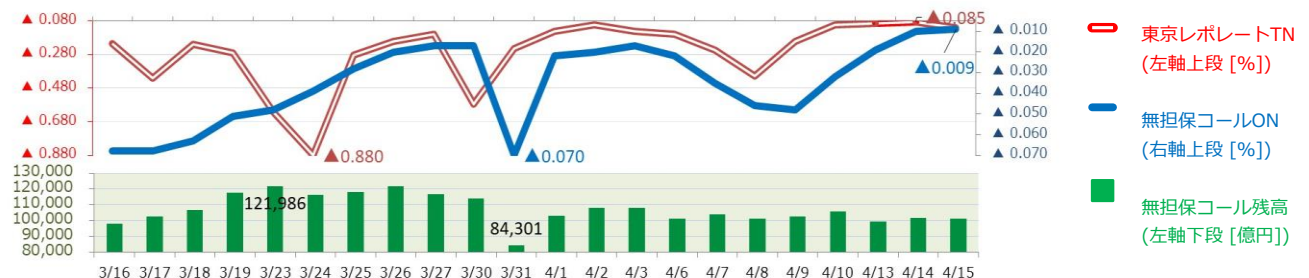
今月の国債買入オペ予定

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	1,500	月1回程度	4月5日	0
1年超3年以下	4750	4,750	5 14 21 26	4月5日	3
3年超5年以下	4500	4,500	5 14 19 26	4月5日	3
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
物価運動債	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