



短期市場の推移

	4月1日	4月2日	4月5日	4月6日
加重平均金利	▲0.014	▲0.012	▲0.010	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.079	▲0.073	▲0.083
無コール残	129,702	134,690	115,207	117,680
ON	88,919	90,092	68,314	71,442
その他	40,783	44,598	46,893	46,238
有コール残	22,484	22,767	21,363	20,729

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.050	0.001	▲0.010	▲0.074
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.078
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.010	▲0.003	▲0.008	▲0.082
2W	▲0.040	0.050	▲0.025	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.086
1M	▲0.009	▲0.006	▲0.008	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.136

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

4月8日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	2月の国際収支		(米)新規失業保険申請件数(前週分)	
	-		(米)セントルイス連銀総裁の講演	
	-		(欧)2月の生産者物価	

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▲0.003%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.002%の水準で出合が見られた。都銀・地銀ともに資金調達ニーズは強いままで、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.010%となった。

都銀・信託			証券		地銀	
▲0.030	~	▲0.010	▲0.011	~	▲0.011	▲0.010 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

都銀・地銀を中心とした堅調な地合が続き、出合水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月7日	4月8日	4月8日	4月9日	4月9日	4月9日
券		+200		▲100		▲1,000
財政		▲6,500		+3,900		▲21,000
過不足		▲6,300		+3,800		▲22,000
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
国庫短期証券買入		+20,000				
国債買入				+7,600		
共通担保(全店)	▲4,900	+1,700				
CP等買入	▲100		▲100			
E T F 買入		+400		+200		
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減		+10,900		+11,600		▲22,000
当座預金残高		5,188,500		5,200,100		5,178,100
準備預金残高		4,586,100	主な需給要因			
積み終了先		4,586,100				
超過準備		4,586,100				
非準備先残高		602,400				
準備預金進捗率		99.9%				国債発行(5年)
平均		74.2%				
乖離率		25.7%				

4月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(4/8~)						
5~10年	4,500	8,577	4,512	▲0.004	▲0.003	73.7
10~25年	2,000	4,492	2,006	▲0.004	▲0.002	47.9
物価連動	600	1,821	600	▲0.090	▲0.136	
社債等買入(4/12~)						
1,250	2,154	1,252	▲0.080	▲0.065	86.7	
国債補完供給(4/7~4/8)						
91	91		▲0.350	▲0.350		
0	0					

マナリーベース (億円)
4月6日時点 6,387,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,646,500
4月8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
4月8日	5年
4月20日	20年
4月28日	2年
5月11日	10年

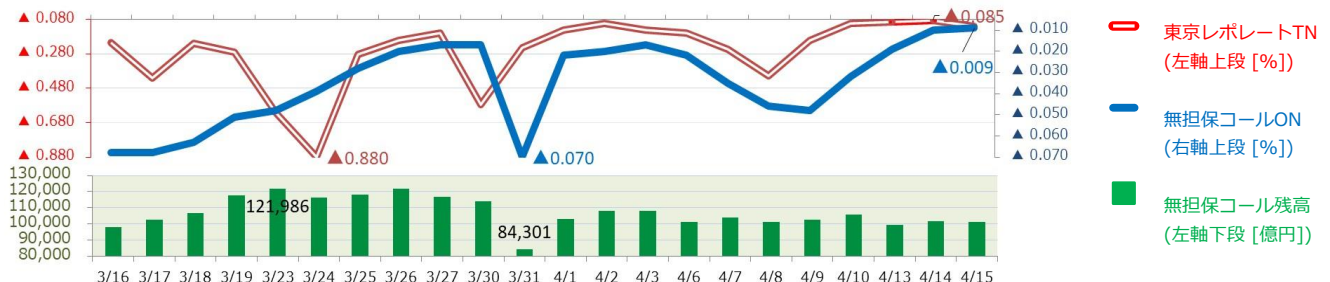
今月の国債買入オペ予定

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	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	4,500	7 14 21 26	4月7日	3
10年超25年以下	2000	2,000	7 14 21 26	4月7日	0
25年超	500	300	19	3月31日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	4月7日	0
変動利付債<四半期>	300	500	4月21日	2月22日	-

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