



短期市場の推移

	4月2日	4月5日	4月6日	4月7日
加重平均金利	▲0.012	▲0.010	▲0.010	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.079	▲0.073	▲0.083	▲0.078
無コール残	134,690	115,207	117,680	128,708
ON	90,092	68,314	71,442	79,655
その他	44,598	46,893	46,238	49,053
有コール残	22,767	21,363	20,729	21,374

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	▲0.045	0.001	▲0.010	▲0.077
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.080
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	-	-	▲0.008	▲0.081
2W	▲0.003	0.050	0.026	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	0.030	▲0.096
2M	-	-	▲0.004	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.114
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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米) 3月 生産者物価コア指数	2.6%
-	-	23:00 (米) 2月 卸売在庫	0.5%
-	-	-	-

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▲0.030%~▲0.002%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	▲0.012 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

3日積みということもあり、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8日	4月9日	4月9日	4月9日	4月12日	4月12日
券	▲100			+700		+1,000
財政	+2,900			▲24,900		▲9,000
過不足	+2,800			▲24,200		▲8,000
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		+7,600				
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入						+1,300
E T F 買入		+200				
国債補充供給	+100	▲100	+100			
当座預金増減	+10,500		▲24,400		▲6,700	
当座預金残高	5,199,000		5,174,600		5,167,900	
準備預金残高	4,596,400	主な需給要因				
積み終了先	4,596,400					
超過準備	4,596,400					
非準備先残高	602,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

4月8日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補充供給(4/8~4/9)	58	58	▲0.350	▲0.350
	0	0		

マネタリーベース (億円)
4月7日時点 6,397,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,646,500
4月9日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国債短期証券入札予定

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22日	6ヶ月

国債入札予定

4月20日	20年
4月28日	2年
5月11日	10年
5月13日	30年

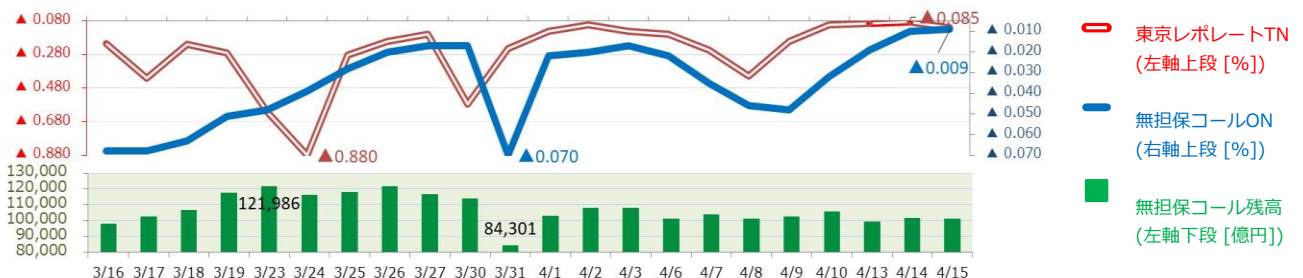
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	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