



短期市場の推移

	4月5日	4月6日	4月7日	4月8日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.010	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.073	▲0.083	▲0.078	▲0.080
無コール残	115,207	117,680	128,708	127,418
ON	68,314	71,442	79,655	77,890
その他	46,893	46,238	49,053	49,528
有コール残	21,363	20,729	21,374	20,462

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	▲0.045	0.001	▲0.010	▲0.078
T/N	▲0.007	▲0.001	▲0.003	▲0.077
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.008	▲0.002	▲0.007	▲0.080
2W	-	-	0.030	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.090
1M	0.030	0.150	0.083	▲0.094
2M	-	-	▲0.008	-
3M	0.020	0.150	0.094	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.114
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12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▲0.003%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。3日積みであったものの同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.010%となった。本日公表された4月積み期のマクロ加算残高にかかる基準比率は前月対比+5.0%の20.5%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

大きく動きを変える金融機関も少なく、本日対比横ばいを想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月9日		4月12日		4月13日	
券	+700		+600		+0	
財政	▲24,700		▲4,900		+1,000	
過不足	▲24,000		▲4,300		+1,000	
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
CP等買入	▲300		▲100			
社債等買入					+1,300	
E T F 買入					+200	
国債補完供給	+100	▲500	+500			
当座預金増減	▲24,700		▲2,400		+1,000	
当座預金残高	5,174,300		5,171,900		5,172,900	
準備預金残高	4,584,400		主な需給要因			
積み終了先	4,584,400		国庫短期証券発行・償還(3M・6M)			
超過準備	4,584,400					
非準備先残高	589,900					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	87.1%					
乖離率	12.9%					

4月9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(4/9~4/12)	490	490	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
4月8日時点 6,408,500

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,646,500
4月12日以降の残り所要積数 0
平均 0

国庫短期証券入札予定

4月16日	3ヶ月 第987回
4月19日	1年
4月22日	6ヶ月
4月23日	3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

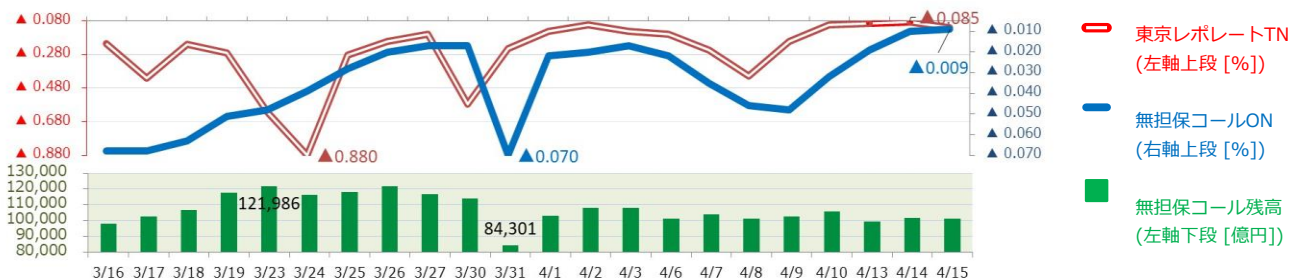
今月の国債買入オペ予定

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	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