



短期市場の推移

	4月6日	4月7日	4月8日	4月9日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.010	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.078	▲0.080	▲0.077
無コール残	117,680	128,708	127,418	118,393
ON	71,442	79,655	77,890	69,585
その他	46,238	49,053	49,528	48,808
有コール残	20,729	21,374	20,462	19,989

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	▲0.012	▲0.081
T/N	▲0.007	▲0.001	▲0.002	▲0.086
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	▲0.008	0.001	▲0.002	▲0.086
2W	▲0.003	0.045	0.015	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 マネーストック (3月)	-	21:30 (米)消費者物価コア指数 (3月)	1.6%
17:00頃 日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-	(米)フィラデルフィア連銀 総裁の講演	
17:00頃 日本銀行による国庫短期証券の銘柄別買入額	-		

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▲0.008%の割合から始まり、その後は主に▲0.01%~▲0.003%の水準で出合が見られた。3日積み要因の剥落や積み期終盤でビットサイドの一部が調達を控えており同加重平均金利(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	- ~ -	▲0.011 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

大きく動きを変えるビットサイドも少なく、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12日	4月13日	4月12日	4月13日	4月12日	4月13日
券		+600		+600		+0
財政		▲7,000		+2,900		▲7,000
過不足		▲6,400		+3,500		▲7,000
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	▲100		▲300			
社債等買入		+1,300	▲200			
E T F買入		+200				
国債補充供給	+500					
当座預金増減		▲4,500		+3,000		▲7,000
当座預金残高		5,169,800		5,172,800		5,165,800
準備預金残高		4,548,000	主な需給要因			
積み終了先		4,548,000	源泉税揚げ			
超過準備		4,548,000				
非準備先残高		621,800				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		90.3%				
乖離率		9.7%				

4月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(4/12~4/13)	28	28	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
4月9日時点 6,383,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,646,500
4月13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 第988回
4月22日	6ヶ月
4月23日	3ヶ月
4月20日	20年
4月28日	2年
5月11日	10年
5月13日	30年

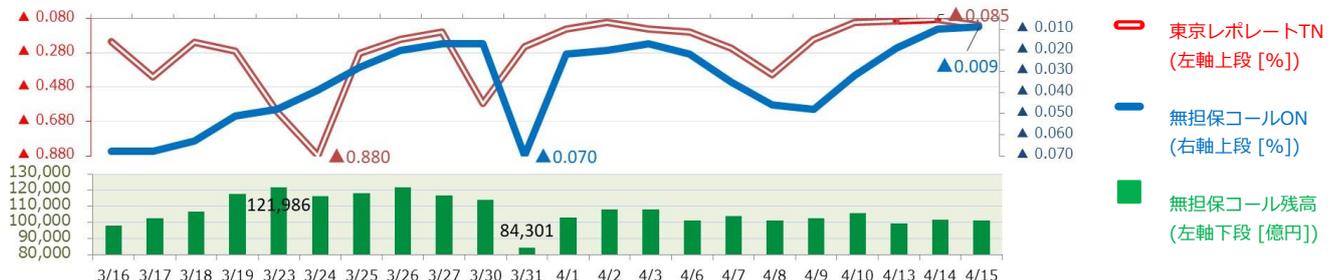
今月の国債買入オペ予定

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
4月19日以下	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