



短期市場の推移

	4月7日	4月8日	4月9日	4月12日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.010	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.078	▲0.080	▲0.077	▲0.086
無コール残	128,708	127,418	118,393	119,053
ON	79,655	77,890	69,585	69,435
その他	49,053	49,528	48,808	49,618
有コール残	21,374	20,462	19,989	18,978

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	▲0.013	▲0.099
T/N	▲0.010	0.001	▲0.004	▲0.111
S/N	-	-	▲0.010	-
1W	-	-	-	▲0.095
2W	-	-	-	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.096
1M	▲0.009	▲0.003	▲0.007	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
15:17	【挨拶】黒田総裁 (第96回信託大会)	(米)ベージュブック	
	-	(米)パウエルFRB議長の講演(ワシントン)	
	-	(欧)2月の鉱工業生産	

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.003%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▲0.001%の▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.011 ~ ▲0.011	▲0.010 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

積み期終盤に入り地銀業態を中心に調達ニーズが弱まり、出合いの水準は本日対比やや低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月13日	4月14日	4月13日	4月14日	4月13日	4月14日
券	+700	▲200	+700	▲200	+1,000	▲1,000
財政	+1,000	▲5,800	+1,000	▲5,800	+93,000	+93,000
過不足	+1,700	▲6,000	+1,700	▲6,000	+92,000	+92,000
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				+10,000		
CP等買入	▲300		▲200			
社債等買入	▲200					
国債補充供給		▲200	+200			
当座預金増減	+1,000	+4,000	+1,000	+4,000	+92,000	+92,000
当座預金残高	5,170,800	5,174,800	5,170,800	5,174,800	5,266,800	5,266,800
準備預金残高	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800
積み終了先	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800
超過準備	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800	4,544,800
非準備先残高	626,000	626,000	626,000	626,000	626,000	626,000
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%	93.5%
乖離率	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%	6.5%

4月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(4/14~)	10,000	31,884	10,004	0.003	0.004	91.9
米ドル資金供給(4/15~4/22)	1	1	0.310	0.310		
米ドル資金供給(4/15~7/9)	0	0	0.330	0.330		
CP等買入(4/16~)	4,000	8,189	4,000	▲0.029	▲0.021	33.3
国債補充供給(4/13~4/14)	176	176	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(4/14~4/23)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マナリーベース (億円)
4月12日時点 6,378,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,646,500
4月14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

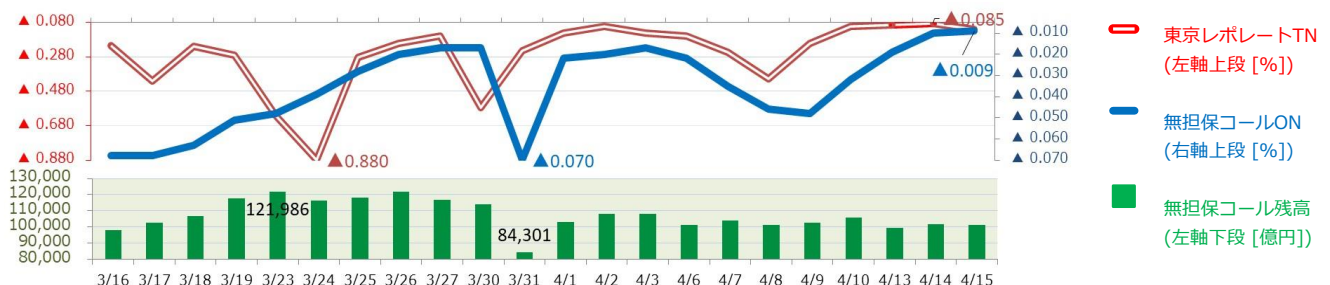
今月の国債買入オペ予定

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

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