



短期市場の推移

	4月8日	4月9日	4月12日	4月13日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.012	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.080	▲0.077	▲0.086	▲0.111
無コール残	127,418	118,393	119,053	115,076
ON	77,890	69,585	69,435	65,423
その他	49,528	48,808	49,618	49,653
有コール残	20,462	19,989	18,978	20,008

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	▲0.060	0.001	▲0.013	▲0.086
T/N	-	-	▲0.001	▲0.087
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.007	0.001	▲0.005	▲0.091
2W	▲0.040	▲0.001	▲0.017	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.095
1M	▲0.015	▲0.005	▲0.010	▲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15日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	14:00	地域経済報告 (4月)	-	(米) 3月 小売売上高
-	【挨拶】 黒田総裁 (支店長会議)	-	(米) 4月 NY連銀製造業指数	-
-	-	-	(米) 4月 フィラデルフィア連銀製造業指数	-

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▲0.030%~▲0.003%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横這いの▲0.013%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.01 ~ ▲0.01	▲0.015 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

積み最終日ということもあり、引き続きビッドサイドの調達ニーズが強く、堅調な地合が予想される。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月14日	4月15日	4月14日	4月15日	4月16日	4月17日
券	▲100	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲5,000	+78,300	+8,000	+8,000	+8,000	+8,000
過不足	▲5,100	+77,400	+7,000	+7,000	+7,000	+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
国庫短期証券買入		+10,000				
国債買入				+14,000		
CP等買入	▲200		▲100			+4,000
被災地金融機関支援					▲1,300	+1,300
国債補充供給	+200	▲400	+400			
当座預金増減	+4,500	+91,700	+11,000			
当座預金残高	5,175,300	5,267,000	5,278,000			
準備預金残高	4,556,200	主な需給要因				
積み終了先	4,556,200					
超過準備	4,556,100					
非準備先残高	619,100	年金定時払い				
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.8%					
乖離率	3.2%					

4月14日のオペ結果

【(億円)】※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(4/15~)						
1~3年	4,750	15,309	4,756	▲0.002	▲0.002	89.3
3~5年	4,500	14,887	4,507	▲0.007	▲0.004	2.9
5~10年	4,500	11,444	4,510	▲0.014	▲0.013	77.5
国債補充供給(4/14~4/15)						
	182	182	▲0.350	▲0.350		
	197	197	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
4月13日時点 6,378,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,646,500
4月15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

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

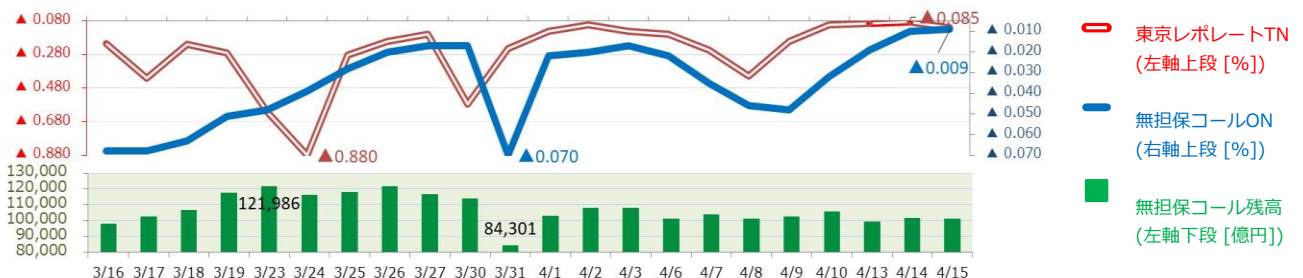
今月の国債買入オペ予定

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14日	2
3年超5年以下	4500	4,500	5 14 19 26	4月14日	2
5年超10年以下	4500	4,500	7 14 21 26	4月14日	2
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
物価運動債	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