



短期市場の推移

	4月9日	4月12日	4月13日	4月14日
加重平均金利	▲0.010	▲0.012	▲0.013	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.077	▲0.086	▲0.111	▲0.087
無コール残	118,393	119,053	115,076	121,789
ON	69,585	69,435	65,423	73,996
その他	48,808	49,618	49,653	47,793
有コール残	19,989	18,978	20,008	20,600

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	▲0.055	0.010	▲0.010	▲0.082
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004	▲0.089
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.009	0.000	▲0.005	▲0.090
2W	▲0.010	0.200	0.010	▲0.091
3W	-	-	▲0.001	▲0.095
1M	▲0.015	0.200	0.076	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
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16日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	17:00	業態別の日銀当座預金残高(3月)	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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

積み最終日となる本日の無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲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+0.003%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.01 ~ ▲0.01	▲0.020 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

新積み期初日のためビッドサイドは慎重な動きとなり、出合の水準は低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月15日	4月16日	4月16日	4月17日	4月19日	4月20日
券	▲900	▲100	▲100	▲100	+1,000	+1,000
財政	+77,300	▲400	▲400	▲400	+9,000	+9,000
過不足	+76,400	▲500	▲500	▲500	+10,000	+10,000
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		+14,000				
CP等買入	▲100		▲400	+4,000		
被災地金融機関支援			▲1,300	+1,300		
国債補完供給	+400	▲600	+600			
当座預金増減	+90,100	+3,700	+3,700	+10,000		
当座預金残高	5,265,400	5,269,100	5,269,100	5,279,100		
準備預金残高	4,629,900	主な需給要因				
積み終了先	4,629,900	国庫短期証券発行・償還(3M)				
超過準備	4,629,900					
非準備先残高	635,500					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

4月15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(4/15~4/16)	535	535	▲0.350	▲0.350		
	42	42	▲0.350	▲0.350		

マナリーベース (億円)
4月14日時点 6,383,000

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,599,500
4月16日以降の残り所要	
積数	3,599,500
平均	120,000

国庫短期証券入札予定

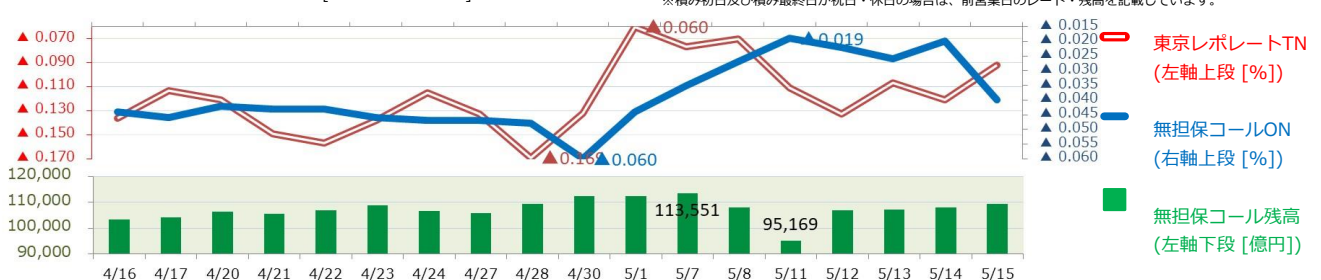
4月16日	3ヶ月 第987回
4月19日	1年 第988回
4月22日	6ヶ月 第989回
4月23日	3ヶ月

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4月積み期 [4月16日~5月15日]



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