



短期市場の推移

	4月12日	4月13日	4月14日	4月15日
加重平均金利	▲0.012	▲0.013	▲0.013	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.111	▲0.087	▲0.089
無コール残	119,053	115,076	121,789	113,386
ON	69,435	65,423	73,996	68,803
その他	49,618	49,653	47,793	44,583
有コール残	18,978	20,008	20,600	20,661

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	▲0.080	0.001	▲0.014	▲0.098
T/N	-	-	▲0.001	▲0.095
S/N	-	-	▲0.009	-
1W	▲0.009	▲0.004	▲0.007	▲0.093
2W	▲0.008	▲0.004	▲0.005	▲0.096
3W	▲0.007	▲0.005	▲0.007	▲0.098
1M	▲0.007	▲0.004	▲0.006	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
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19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

積み初日となる本日の無担保コールON物は▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.003%の水準で合出が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.02	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は強く、出合いの水準は横ばいからやや上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月16日		4月19日		4月20日	
券	+0		▲600		▲1,000	
財政	+2,300		+8,200		▲28,000	
過不足	+2,300		+7,600		▲29,000	
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	▲400	+4,000	▲100			
被災地金融機関支援	▲1,300	+1,300				
国債補完供給	+600	▲200	+200			
当座預金増減	+6,300		+7,700		▲29,000	
当座預金残高	5,271,700		5,279,400		5,250,400	
準備預金残高	4,621,000		4,618,700		4,618,700	
積み終了先	4,618,700		4,618,700		4,618,700	
超過準備	3,424,200		3,424,200		3,424,200	
非準備先残高	650,700		650,700		650,700	
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		99.7%	
平均	10.0%		10.0%		10.0%	
乖離率	89.7%		89.7%		89.7%	

4月16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
国債補完供給(4/16~4/19)	200	200	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
4月15日時点 6,474,000

所要	今積期の所要準備額	4月19日以降の残り所要
積数	3,599,500	9,100
平均		300

国庫短期証券入札予定

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	第990回
5月6日	6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

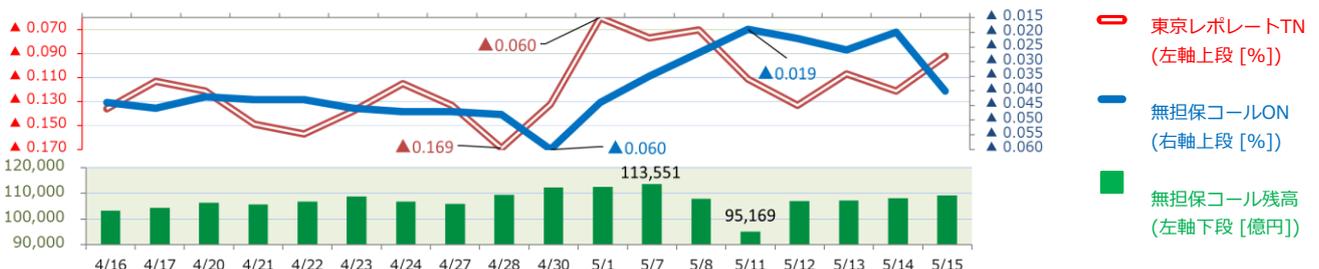
今月の国債買入オペ予定

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4月積み期 [4月16日~5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