

短期市場の推移

[億円] [%]

	10月5日	10月6日	10月7日	10月8日
加重平均金利	▲0.019	▲0.014	▲0.010	▲0.008
東京レポレート(ON)	▲0.070	▲0.073	▲0.071	▲0.079
無コール残	87,549	86,106	92,168	95,044
ON	51,786	48,093	52,855	56,351
その他	35,763	38,013	39,313	38,693
有コール残	22,359	22,497	21,197	21,285

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.050	0.001	▲0.008	▲0.072
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.005	▲0.012	▲0.077
2W	▲0.015	0.020	▲0.007	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	0.030	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.119
6M	-	-	-	▲0.142
1Y	-	-	-	▲0.162

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

10月12日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	企業物価指数(9月)	-	-	-
8:50	8月コア機械受注[前月比]	▲1.0%	-	-
10:00	営業毎旬報告(10月10日)	-	-	-

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▲0.015%~▲0.001%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.008%となった。また、日銀は当座預金のマクロ加算残高にかかる基準比率の見直しについて、10月積み期間は20.5%(前回24.0%)とした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.008	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.015 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達姿勢に大きな変化はなく、出合水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月9日	10月12日	10月13日
券	+0	+800	+0
財政	▲28,400	▲14,900	+1,000
過不足	▲28,400	▲14,100	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+10,000	スタート
CP等買入	▲400	▲200	
ETF買入	+500	+1,400	
国債補完供給	▲200	+200	
米ドル資金供給用担保国債供給	+2,200		
当座預金増減	▲26,300	▲2,700	+1,000
当座預金残高	4,757,500	4,754,800	4,755,800
準備預金残高	4,210,000	主な需給要因	
積み終了先	4,210,000	国庫短期証券 発行・償還 (3M・6M)	
超過準備	4,210,000		
非準備先残高	547,500		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	86.7%		
乖離率	13.3%		

10月9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(10/12~)						
~1年	1,000	2,649	1,003	0.010	0.014	59.8
1~3年	4,200	8,435	4,202	0.000	0.003	15.9
5~10年	4,200	8,281	4,208	▲0.008	▲0.007	80.1
25年~	300	1,862	301	▲0.001	0.000	81.0
国債補完供給(10/9~10/12)						
	219	219	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
10月8日時点 5,968,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,421,200
10月12日以降の残り所要
積数 0
平均 0

国庫短期証券入札予定

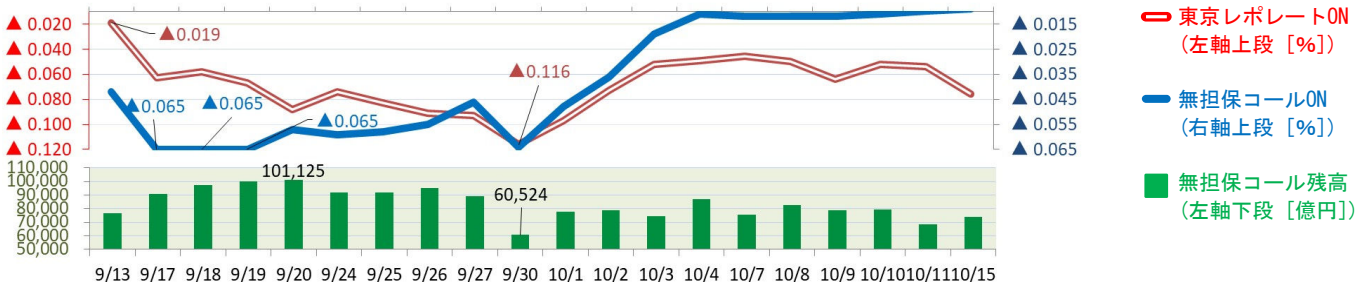
10月16日 3ヶ月 第944回
10月19日 1年
10月22日 6ヶ月
10月23日 3ヶ月
国債入札予定
10月20日 20年
10月27日 2年
11月4日 10年
11月6日 物価連動

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	500~1,500	1,000	月3回程度	10月9日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	10月9日	4
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月7日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	10月9日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 26	10月2日	1
25年超	0~500	300	9 26	10月9日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	9月28日	2
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	-

1年前の市場推移 ○2019年9月積み期 [9月13日~10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。